

Para la ejecución de este sorteo se utilizarán como mínimo cinco bombos que, de izquierda a derecha, representan, las decenas de millar, unidades de millar, centenas, decenas y unidades. Cada uno de ellos contendrá diez bolas numeradas del 0 al 9.

Para la adjudicación de los premios entrarán en juego, en cada extracción, tantos bombos como se requieran para obtener la combinación numérica prevista.

Se utilizarán dos bombos para la determinación de los premios de 120 euros que se adjudicarán, respectivamente, a aquellos billetes cuyas dos últimas cifras sean iguales y estén igualmente dispuestas que las de los números extraídos. Tres bombos para los premios de 300 euros que se adjudicarán, respectivamente, a los billetes cuyas tres últimas cifras sean iguales y estén igualmente dispuestas que las de los números obtenidos. Cuatro bombos para los premios de 1.500 euros que, respectivamente, se adjudicarán a aquellos billetes cuyas cuatro últimas cifras coincidan en orden y numeración con las bolas extraídas. Por último, se utilizarán cinco bombos para adjudicar los dos premios mayores del sorteo mediante extracción simultánea de una bola de cada uno de aquéllos, con lo que las cinco bolas extraídas compondrán el número premiado, determinándose primeramente el segundo premio y después, con idéntica formalidad, el primer premio del sorteo.

De los números formados por las extracciones de cinco cifras correspondientes a los premios primero y segundo se derivarán las aproximaciones y las centenas, como asimismo del premio primero, las terminaciones y el reintegro correspondientes.

Con respecto a las aproximaciones señaladas para los números anterior y posterior de los premios primero y segundo, se entenderá que si saliese premiado, en cualquiera de ellos, el número 00000, su anterior es el 99999 y el siguiente el 00001. Asimismo si el agraciado fuese el 99999, su anterior es el 99998 y el 00000 será el siguiente.

Para la aplicación de los premios de centena se entenderá que si cualquiera de los premios primero o segundo correspondiera, por ejemplo, al número 00025, se considerarán agraciados los 99 números restantes de la misma; es decir, desde el 00000 al 00024 y desde el 00026 al 00099.

Tendrán derecho a premio de 600 euros los billetes cuyas tres últimas cifras sean iguales y estén igualmente dispuestas que las del número que obtenga el premio primero; a premio de 300 euros aquellos billetes cuyas dos últimas cifras coincidan en orden y numeración con las del que obtenga dicho primer premio y, finalmente, tendrán derecho al reintegro de su precio cada uno de los billetes cuya cifra final sea igual a la última cifra del número agraciado con el repetido primer premio.

De los premios de centenas, terminaciones y reintegro ha de entenderse que quedan exceptuados los números de los que, respectivamente se deriven, agraciados con los premios primero y segundo.

Asimismo tendrán derecho al reintegro de su precio todos los billetes cuya última cifra coincida con las que se obtengan en las dos extracciones especiales, que se realizarán del bombo de las unidades.

#### *Premio especial al décimo*

Para proceder a la adjudicación del premio especial a la fracción, se extraerá simultáneamente una bola de dos de los bombos del sorteo que determinarán, respectivamente, la fracción agraciada y la serie a que corresponde.

Ha de tenerse en cuenta que si la bola representativa de la fracción o de la serie fuera el 0, se entenderá que corresponde a la 10.<sup>a</sup>

Este premio especial al décimo, de 2.940.000 euros para una sola fracción de uno de los diez billetes agraciados con el primer premio, será adjudicado a continuación de determinarse el primer premio.

El sorteo se efectuará con las solemnidades previstas en la legislación vigente.

Estos actos serán públicos, y los concurrentes interesados en el sorteo tendrán derecho, con la venia del Presidente, a hacer observaciones sobre dudas que tengan respecto a las operaciones del mismo.

Efectuado el sorteo se expondrán al público la lista oficial de las extracciones realizadas y la lista acumulada ordenada por terminaciones.

#### *Pago de premios*

Los premios inferiores a 30.000 euros por billete, podrán cobrarse en cualquier Administración de Loterías.

Los iguales o superiores a dicha cifra podrán cobrarse en cualquier punto del territorio nacional a través de las entidades financieras que, en cada momento, gestionen las cuentas centrales de Loterías y Apuestas del Estado.

Los premios serán hechos efectivos en cuanto sea conocido el resultado del sorteo a que correspondan y sin más demora que la precisa para practicar la correspondiente liquidación y la que exija la provisión de fondos cuando no alcancen los que en la Administración pagadora existan disponibles.

Madrid, 7 de marzo de 2008.—El Director General de Loterías y Apuestas del Estado, P. D. (Resolución de 10 de septiembre de 2007), el Director de Gestión y Producción de Loterías y Apuestas del Estado, Juan Antonio Cabrejas García.

**4841** *RESOLUCIÓN de 10 de marzo de 2008, de Loterías y Apuestas del Estado, por la que se hace público el resultado del sorteo de Euromillones celebrado el día 7 de marzo y se anuncia la fecha de celebración del próximo sorteo.*

En el sorteo de Euromillones celebrado el día 7 de marzo se han obtenido los siguientes resultados:

Números: 14, 17, 7, 35, 2.  
Estrellas: 6, 1.

El próximo sorteo se celebrará el día 14 de marzo, a las 21,30 horas.

Madrid, 10 de marzo de 2008.—El Director General de Loterías y Apuestas del Estado, P. D. (Resolución de 10 de Septiembre de 2007), el Director de Gestión y Producción de Loterías y Apuestas del Estado, Juan Antonio Cabrejas García.

**4842** *ORDEN EHA/672/2008, de 3 de marzo, por la que se aprueba la relación de valores negociados en mercados organizados, con su valor de negociación medio correspondiente al cuarto trimestre de 2007, a efectos de la declaración del Impuesto sobre el Patrimonio del año 2007.*

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

A tal efecto se hace necesario publicar la mencionada información, para lo cual se ha contado con la colaboración técnica de la Comisión Nacional del Mercado de Valores, que, como Agencia Nacional de Codificación, ha procedido a la consolidación de los datos provenientes de cada una de las cuatro Bolsas de Valores, incorporándose 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 2007; 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 2007, anexas a esta Orden, a efectos de la declaración del Impuesto sobre el Patrimonio del año 2007.

Madrid, 3 de marzo de 2008.—El Vicepresidente Segundo del Gobierno y Ministro de Economía y Hacienda, Pedro Solbes Mira.



### ANEXO A LA ORDEN.

Relación de valores o participaciones con su valor de negociación medio o de liquidación media relativa al cuarto trimestre de 2007, a efectos del impuesto sobre el patrimonio de las Personas Físicas, correspondiente al período impositivo de 2007.

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	141,550
ESTADO	ES0000011470	ESTADO/8,20 OBE 20090228	28/02/2009	8,200	104,976
ESTADO	ES0000011652	ESTADO/6,00 OBE SEGR 20080131	31/01/2008	6,000	100,353
ESTADO	ES0000011660	ESTADO/6,15 OBE SEGR 20130131	31/01/2013	6,150	109,283
ESTADO	ES0000011702	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20130131	31/01/2013	C	80,787
ESTADO	ES0000011801	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20080131	31/01/2008	C	99,182
ESTADO	ES0000011843	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20120131	31/01/2012	C	84,856
ESTADO	ES0000011868	ESTADO/6,00 OBE SEGR 20290131	31/01/2029	6,000	118,754
ESTADO	ES0000011876	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20290131	31/01/2029	C	37,880
ESTADO	ES0000011884	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20140131	31/01/2014	C	77,676
ESTADO	ES0000011918	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170131	31/01/2017	C	67,905
ESTADO	ES0000012064	ESTADO/5,15 OBE SEGR 20090730	30/07/2009	5,150	101,860
ESTADO	ES0000012098	ESTADO/4,75 OBE SEGR 20140730	30/07/2014	4,750	103,548
ESTADO	ES00000120D1	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20370131	31/01/2037	C	26,284
ESTADO	ES00000120E9	ESTADO/3,25 BOEST SEGR 20100730	30/07/2010	3,250	98,064
ESTADO	ES00000120G4	ESTADO/3,15 OBE SEGR 20160131	31/01/2016	3,150	92,342
ESTADO	ES00000120H2	ESTADO/2,90 BOEST SEGR 20081031	31/10/2008	2,900	98,873
ESTADO	ES00000120J8	ESTADO/3,80 OBE SEGR 20170131	31/01/2017	3,800	96,096
ESTADO	ES00000120L4	ESTADO/3,90 BOEST SEGR 20121031	31/10/2012	3,900	99,012
ESTADO	ES00000120N0	ESTADO/4,90 OBE SEGR 20400730	30/07/2040	4,900	103,723
ESTADO	ES00000120O8	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20400730	30/07/2040	C	21,968
ESTADO	ES00000120X9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20121031	31/10/2012	C	81,914
ESTADO	ES0000012122	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20090730	30/07/2009	C	93,536
ESTADO	ES0000012239	ESTADO/4,00 OBE SEGR 20100131	31/01/2010	4,000	100,061
ESTADO	ES0000012296	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20100131	31/01/2010	C	92,207
ESTADO	ES0000012304	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20140730	30/07/2014	C	76,349
ESTADO	ES0000012387	ESTADO/5,40 OBE SEGR 20110730	30/07/2011	5,400	104,507
ESTADO	ES0000012411	ESTADO/5,75 OBE 20320730	30/07/2032	5,750	116,409
ESTADO	ES0000012429	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20110730	30/07/2011	C	86,841
ESTADO	ES0000012452	ESTADO/5,35 OBE SEGR 20111031	31/10/2011	5,350	104,533
ESTADO	ES0000012551	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20081031	31/10/2008	C	96,501
ESTADO	ES0000012593	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20320730	30/07/2032	C	32,341
ESTADO	ES0000012627	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170730	30/07/2017	C	65,217
ESTADO	ES0000012783	ESTADO/5,50 OBE SEGR 20170730	30/07/2017	5,500	109,003
ESTADO	ES0000012791	ESTADO/5,00 OBE SEGR 20120730	30/07/2012	5,000	103,734
ESTADO	ES0000012809	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20120730	30/07/2012	C	82,923
ESTADO	ES0000012817	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20170730	30/07/2017	C	66,466
ESTADO	ES0000012866	ESTADO/4,20 OBE SEGR 20130730	30/07/2013	4,200	100,464
ESTADO	ES0000012882	ESTADO/3,60 BOEST SEGR 20090131	31/01/2009	3,600	99,424
ESTADO	ES0000012890	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20090131	31/01/2009	C	95,249
ESTADO	ES0000012916	ESTADO/4,40 OBE SEGR 20150131	31/01/2015	4,400	101,049
ESTADO	ES0000012932	ESTADO/4,20 OBE SEGR 20370131	31/01/2037	4,200	92,924
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095150	GENCAT/8,55 OB 20090131	31/01/2009	8,550	93,769
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095598	GENCAT/5,00 OB 20090715	15/07/2009	5,000	101,000
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095770	GENCAT/5,20 OB 20120930	30/09/2012	5,200	107,554
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095804	GENCAT/3,625 BO 20080930	30/09/2008	3,625	99,242
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095846	GENCAT/3,75 BO 20100215	15/02/2010	3,750	98,206
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095861	GENCAT/3,875 OB 20150915	15/09/2015	3,875	97,348
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095895	GENCAT/4,30 OB 20161115	15/11/2016	4,300	98,578
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095903	GENCAT/4,12 BO 20130423	23/04/2013	4,125	98,874
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958V5	GENCAT/PAG 20080219	19/02/2008		99,119
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958W3	GENCAT/PAG 20080304	04/03/2008		99,035
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958Y9	GENCAT/PAG 20080318	18/03/2008		98,589
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958Z6	GENCAT/PAG 20080115	15/01/2008		99,456
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959A7	GENCAT/PAG 20080415	15/04/2008		98,385
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959B5	GENCAT/PAG 20080429	29/04/2008		97,878
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959C3	GENCAT/PAG 20080520	20/05/2008		97,858
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959D1	GENCAT/PAG 20080603	03/06/2008		98,117
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959E9	GENCAT/PAG 20080617	17/06/2008		97,435
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959F6	GENCAT/PAG 20080708	08/07/2008		97,360
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959G4	GENCAT/PAG 20080722	22/07/2008		97,315
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959H2	GENCAT/PAG 20080909	09/09/2008		96,757
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959I0	GENCAT/PAG 20080923	23/09/2008		96,136
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959J8	GENCAT/PAG 20081021	21/10/2008		96,213
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959K6	GENCAT/PAG 20081111	11/11/2008		95,768
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959L4	GENCAT/PAG 20081202	02/12/2008		95,676
GOBIERNO VASCO	ES0000106411	GOB.VASCO/5,00 OB 20080624	24/06/2008	5,000	101,900
GOBIERNO VASCO	ES0000106429	GOB.VASCO/5,55 OB 20141126	26/11/2014	5,550	110,915
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0255281042	INST.CAT.FINVAR OB 20130519	19/05/2013	V	99,770
JUNTA DE ANDALUCIA	ES0000090433	JUNTA.AND/4,30 OB SEGR 20131010	10/10/2013	4,300	99,570
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0000230195	BCO.CTO.LOCAL/4,00 CEDHIP 20101231	31/12/2010	4,000	5,89
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0000230203	BCO.CTO.LOCAL/4,00 CEDHIP 20110930	30/09/2011	4,000	5,86
EMPRESTITO DEL MAZJEN	ES0002750067	EMPTO.MAZJEN/4,00 OB 20220701	01/07/2022	4,000	102,77
GENERALIDAD VALENCIANA	ES0500105BQ6	GENVAL/PAG 20080213	13/02/2008		986,79

(\*) ANCV: Agencia Nacional de Codificación de Valores

(\*\*) V: Cupón Variable, C: Cupón Cero

**RENDA FIJA**  
**LETRAS DEL TESORO**

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
ESTADO	ES0L00802220	ESTADO/LT 20080222	22/02/2008	C	98,929
ESTADO	ES0L00803202	ESTADO/LT 20080320	20/03/2008	C	98,612
ESTADO	ES0L00804184	ESTADO/LT 20080418	18/04/2008	C	98,327
ESTADO	ES0L00805231	ESTADO/LT 20080523	23/05/2008	C	98,032
ESTADO	ES0L00806205	ESTADO/LT 20080620	20/06/2008	C	97,635
ESTADO	ES0L00807187	ESTADO/LT 20080718	18/07/2008	C	97,444
ESTADO	ES0L00808227	ESTADO/LT 20080822	22/08/2008	C	96,961
ESTADO	ES0L00809191	ESTADO/LT 20080919	19/09/2008	C	96,511
ESTADO	ES0L00810173	ESTADO/LT 20081017	17/10/2008	C	96,394
ESTADO	ES0L00811213	ESTADO/LT 20081121	21/11/2008	C	96,270
ESTADO	ES0L00812195	ESTADO/LT 20081219	19/12/2008	C	96,115

**RENTA FIJA****OBLIGACIONES**

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845179	ABE/4,75 OB 20140211	11/02/2014	4,750	99.884,66
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845187	ABE/4,95 OB 20130808	08/08/2013	4,950	99.667,33
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845203	ABE/4,375 OB 20200330	30/03/2020	4,375	91.518,92
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845211	ABE/5,125 OB 20170612	12/06/2017	5,125	49.791,55
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211847076	AUMAR/3,53 OB 20090608	08/06/2009	3,530	977,02
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR-LEONESA, S.A.	ES0211843083	AUCALSA/4,00 OB 20140608	08/06/2014	4,000	479,59
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR-LEONESA, S.A.	ES0211843091	AUCALSA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	468,23
AUTOPISTA VASCO-ARAGONESA, CONCESIONARIA ESF	ES0211837077	AVASA/3,55 OB 20150615	15/06/2015	3,550	910,50
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑA	ES0211839099	AUDASA/3,90 OB 20080327	27/03/2008	3,900	597,04
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑA	ES0211839107	AUDASA/4,19 OB 20110531	31/05/2011	4,190	487,32
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑA	ES0211839115	AUDASA/4,33 OB 20120516	16/05/2012	4,330	584,31
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑA	ES0211839123	AUDASA/3,83 OB 20130626	26/06/2013	3,830	467,58
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑA	ES0211839131	AUDASA/4,00 OB 20140608	08/06/2014	4,000	478,16
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑA	ES0211839149	AUDASA/3,32 OB 20151212	12/12/2015	3,320	466,95
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑA	ES0211839156	AUDASA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	464,38
AUTOVIA DE LOS VIÑEDOS, S.A.CONCES.D LA JUNTA DI	ES0211966009	AUVISA/4,79 OB 20271215	15/12/2027	4,790	96.266,53
AYUNTAMIENTO DE MADRID	ES0201001155	AYTO.MAD/4,65 OB 20170110	10/01/2017	4,650	99.731,60
AYUNTAMIENTO DE MADRID	ES0201001163	AYTO.MAD/VAR OB 20221010	10/10/2022	V	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211057	BBVA/VAR OB 20080722	22/07/2008	V	149.035,42
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211073	BBVA/VAR OB SUBD 20130717	17/07/2013	V	99.876,49
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211081	BBVA/VAR OB SUBD 20151112	12/11/2015	V	99.582,20
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211099	BBVA/VAR OB SUBD 20191020	20/10/2019	V	96.529,22
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211107	BBVA/VAR OB SUBD 20220216	16/02/2022	V	49.785,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0215483001	CA.POSTAL/VAR OB 20080805	05/08/2008	V	149.504,74
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213180005	ATL/VAR OB SUBD 20080801	01/08/2008	V	599,96
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213180013	ATL/VAR OB SUBD 20101001	01/10/2010	V	600,00
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	100.030,45
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860036	SAB/VAR OB SUBD 20160525	25/05/2016	V	99.606,67
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980016	BVA/VAR OB SUBD 20110329	29/03/2011	V	6.029,77
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980024	BVA/VAR OB SUBD 20141215	15/12/2014	V	3.015,36
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980032	BVA/VAR OB SUBD 20150615	15/06/2015	V	50.043,74
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980040	BVA/VAR OB SUBD 20170323	23/03/2017	V	49.988,60
BANCO ETCHEVERRIA, S.A.	ES0213441019	BCO.ETCHEVERR/VAR OB SUBD 20151220	20/12/2015	V	997,77
BANCO EUROPEO DE INVERSIONES	ES02134690Y4	BEI/5,00 OB 20080317	17/03/2008	5,000	601,19
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051008	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20130630	30/06/2013	V	595,24
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051016	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20131030	30/10/2013	V	595,03
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051024	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20160421	21/04/2016	V	49.851,73
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051032	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20161030	30/10/2016	V	50.010,28
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051040	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD PERP		V	49.830,21
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580006	GUI/4,75 OB SUBD 20110415	15/04/2011	4,750	503,31
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580014	GUI/4,50 OB SUBD 20121015	15/10/2012	4,500	503,70
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580022	GUI/4,20 OB SUBD 20141015	15/10/2014	4,200	483,56
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580030	GUI/VAR OB SUBD 20160321	21/03/2016	V	99.991,09
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580048	GUI/VAR OB 20220418	18/04/2022	V	50.000,00
BANCO PASTOR, S.A.	ES0213770003	PAS/VAR OB SUBD 20130930	30/09/2013	V	10.051,09
BANCO PASTOR, S.A.	ES0213770011	PAS/VAR OB SUBD PERP		V	100.740,13
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0213540000	BBE/VAR OB SUBD 20130929	29/09/2013	V	100.449,18
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0213540018	BBE/VAR OB SUBD 20160323	23/03/2016	V	97.627,25
BANKINTER, S.A.	ES0213679014	BKT/5,00 OB SUBD 20080529	29/05/2008	5,000	601,94
BANKINTER, S.A.	ES0213679022	BKT/5,70 OB SUBD 20121218	18/12/2012	5,700	6.143,64
BANKINTER, S.A.	ES0213679048	BKT/VAR OB CONV 20090102	22/01/2008	V	24,98
BANKINTER, S.A.	ES0213679089	BKT/VAR OB CONV 20100405	22/01/2008	V	25,28
BANKINTER, S.A.	ES0213679097	BKT/VAR OB SUBD 20130626	26/06/2013	V	100.471,47
BANKINTER, S.A.	ES0213679113	BKT/VAR OB SUBD 20140929	29/09/2014	V	100.103,26
BANKINTER, S.A.	ES0213679121	BKT/VAR OB 20150316	16/03/2015	V	486,30
BANKINTER, S.A.	ES0213679147	BKT/VAR OB SUBD 20160623	23/06/2016	V	99.851,38
BANKINTER, S.A.	ES0213679170	BKT/VAR OB SUBD 20170316	16/03/2017	V	99.545,65
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	600,01
BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITET	ES0214100002	BBK/VAR OB SUBD 20150928	28/09/2015	V	99.808,04
BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITET	ES0214100010	BBK/VAR OB SUBD 20160301	01/03/2016	V	99.736,15
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0257080004	BPEF/VAR OB SUBD 20140630	30/06/2014	V	993,20
CABILDO INSULAR DE TENERIFE	ES0201330000	CBDO.TEN/VAR OB 20111217	17/12/2011	V	992,60
CABILDO INSULAR DE TENERIFE	ES0201330026	CBDO.TEN/VAR OB 20141218	18/12/2014	V	992,62
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDF	ES0214958011	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20180108	08/01/2018	V	30,00
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDF	ES0214958029	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20180804	04/08/2018	V	600,00
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDF	ES0214958037	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20190126	26/01/2019	V	599,98
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDF	ES0214958045	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20201209	09/12/2020	V	98.726,77
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDF	ES0214958052	CAIXANOVA/VAR OB SUBD PERP		V	50.344,07
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDF	ES0214958060	CAIXANOVA/VAR OB 20160531	31/05/2016	V	49.800,30
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDF	ES0214958110	CAIXANOVA/VAR OB 20140613	13/06/2014	V	49.828,50
CAIXA D'ESTALVIS COMARCAL DE MANLLEU	ES0214841027	CA.MANLLEU/VAR OB SUBD 20130601	01/06/2013	V	499,91
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840060	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20100701	01/07/2010	V	1.566,16
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840094	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20110201	01/02/2011	V	1.573,77
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840201	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20150519	19/05/2015	V	1.503,91
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840235	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20200220	20/02/2020	V	1.499,58
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840250	CA.CATALUNYA/VAR OB 20120706	06/07/2012	V	99.287,54
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840318	CA.CATALUNYA/VAR OB 20131018	18/10/2013	V	49.900,70
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840334	CA.CATALUNYA/VAR OB 20140124	24/01/2014	V	49.910,45
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0213249008	CA.GIRONA/VAR OB SUBD 20160921	21/09/2016	V	99.815,80
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0214850051	CA.MANRESA/VAR OB SUBD 20160505	05/05/2016	V	99.565,95
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0214973051	CA.SABADELL/VAR OB SUBD 20200128	28/01/2020	V	100.032,03
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0214973069	CA.SABADELL/VAR OB SUBD 20170215	15/02/2017	V	49.979,66
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0314973027	CA.SABADELL/VAR OB SUBD PERP		V	599,05
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346000	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20150527	27/05/2015	V	601,02
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346018	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20151027	27/10/2015	V	601,04
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346026	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20160427	27/04/2016	V	600,54
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346034	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20161027	27/10/2016	V	600,61
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346042	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20170127	27/01/2017	V	500,30
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346059	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20171127	27/11/2017	V	500,49
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346067	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20180727	27/07/2018	V	498,24
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	999,90

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974042	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20190730	30/07/2019	V	999,75
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974067	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20210809	09/08/2021	V	98.687,35
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974075	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD PERP	V	V	50.005,76
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974083	CA.TERRASSA/VAR OB 20220312	12/03/2022	V	50.000,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974091	CA.TERRASSA/VAR OB 20170627	27/06/2017	V	100.000,00
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966006	CA.PENEDES/VAR OB SUBD PERP	V	V	602,43
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966014	CA.PENEDES/VAR OB SUBD PERP	V	V	1.000,97
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966022	CA.PENEDES/VAR OB SUBD 20161222	22/12/2016	V	999,78
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0214846042	CA.LAIETANA/VAR OB SUBD 20211010	10/10/2021	V	999,88
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0214846059	CA.LAIETANA/VAR OB SUBD 20350315	15/03/2035	V	999,87
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979058	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20091215	15/12/2009	V	999,98
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979066	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20111106	06/11/2011	V	999,84
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979082	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20121001	01/10/2012	V	999,89
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979116	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20131001	01/10/2013	V	999,79
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	1.000,00
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0214826002	CA.JASTUR/VAR OB SUBD 20121230	30/12/2012	V	100,02
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214825012	CA.ALBACETE/VAR OB SUBD PERP	V	V	612,40
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214825020	CA.ALBACETE/VAR OB SUBD PERP	V	V	609,43
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214842017	CA.CUENCA-C.R./VAR OB SUBD PERP	V	V	301,96
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214842025	CA.CUENCA-C.R./VAR OB PREF PERP	V	V	304,18
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424013	CCM/VAR OB SUBD 20080930	30/09/2008	V	301,75
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424070	CCM/VAR OB SUBD 20090515	15/05/2009	V	300,51
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424096	CCM/VAR OB SUBD 20110604	04/06/2011	V	600,00
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424120	CCM/VAR OB SUBD 20141220	20/12/2014	V	200.603,33
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424138	CCM/VAR OB SUBD 20171214	14/12/2017	V	100.059,22
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424153	CCM/VAR OB 20130728	28/07/2013	V	99.902,45
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424161	CCM/VAR OB SUBD PERP	V	V	100.169,52
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424179	CCM/VAR OB 20140528	28/05/2014	V	99.982,83
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843015	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD PERP	V	V	601,23
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843023	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD PERP	V	V	601,01
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843080	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20121001	01/10/2012	V	580,97
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843098	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20131103	03/11/2013	V	592,45
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843106	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20140401	01/04/2014	V	591,57
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843114	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20150104	04/01/2015	V	593,76
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843122	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20150704	04/07/2015	V	572,76
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843130	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20160912	12/09/2016	V	49.745,50
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843148	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD PERP	V	V	49.928,61
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845002	CAI/VAR OB SUBD 20131222	22/12/2013	V	999,99
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845010	CAI/VAR OB SUBD 20140629	29/06/2014	V	100.317,18
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845028	CAI/VAR OB SUBD 20160525	25/05/2016	V	49.858,48
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845036	CAI/VAR OB SUBD 20190228	28/02/2019	V	999,94
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600035	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP	V	V	302,28
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600043	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP	V	V	304,61
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600050	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP	V	V	300,47
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600068	CA.MURCIA/VAR OB SUBD 20081215	15/12/2008	V	300,47
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600076	CA.MURCIA/VAR OB SUBD 20081230	30/12/2008	V	300,48
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600084	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP	V	V	300,48
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600092	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP	V	V	300,48
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	499,97
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600217	CA.MURCIA/VAR OB SUBD 20140315	15/03/2014	V	101.040,00
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0214854012	CAJADUERO/VAR OB SUBD 20150630	30/06/2015	V	50.033,50
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975007	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20121010	10/10/2012	V	999,97
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975015	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20140330	30/03/2014	V	999,94
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975023	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20151213	13/12/2015	V	49.953,82
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0214977037	BANCAJA/VAR OB SUBD PERP	V	V	597,40
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0214977052	BANCAJA/VAR OB SUBD 20220704	04/07/2022	V	988,45
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0214977060	BANCAJA/3,94 OB 20150918	18/09/2015	3,940	990,73
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0214977078	BANCAJA/VAR OB SUBD 20181129	29/11/2018	V	100.105,07
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0214977086	BANCAJA/VAR OB 20120606	06/06/2012	V	98.791,45
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0214977094	BANCAJA/VAR OB 20160125	25/01/2016	V	99.717,04
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0214977102	BANCAJA/VAR OB SUBD PERP	V	V	92.805,62
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0214977128	BANCAJA/4,25 OB 20130526	26/05/2013	4,250	97.557,88
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0214977136	BANCAJA/VAR OB SUBD 20130923	23/09/2013	V	99.086,72
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0214977144	BANCAJA/4,375 OB 20170214	14/02/2017	4,375	98.435,84
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0214977151	BANCAJA/VAR OB 20140423	23/04/2014	V	49.722,55
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0215307028	CA.SAGUNTO/VAR OB SUBD PERP	V	V	605,02
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0214957013	CA.VITAL/10,00 OB SUBD PERP	V	10,000	303,92
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400014	CAM/VAR OB SUBD PERP	V	V	604,30
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400048	CAM/VAR OB SUBD PERP	V	V	600,02
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400055	CAM/VAR OB 20150815	15/08/2015	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0215395015	CAM/VAR OB SUBD PERP	V	V	608,24
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES0214961015	CA.BURGOS/1,63 OB 20140704	04/07/2014	1,630	100.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0214926018	SA.NOSTRA/VAR OB SUBD 20141230	30/12/2014	V	100.249,62
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0214926026	SA.NOSTRA/VAR OB SUBD 20150318	18/03/2015	V	1.000,03
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0264730039	CAJASUR/VAR OB SUBD 20131201	01/12/2013	V	500,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0264730047	CAJASUR/VAR OB SUBD 20131205	05/12/2013	V	100.920,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0264730054	CAJASUR/VAR OB SUBD 20150311	11/03/2015	V	100.188,47
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0264730062	CAJASUR/1,50 OB 20180315	15/03/2018	1,500	50.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMA	ES0214987028	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20171115	15/11/2017	V	500,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMA	ES0214987044	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20191021	21/10/2019	V	499,98
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMA	ES0214987069	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20200401	01/04/2020	V	500,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMA	ES0214987077	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20210425	25/04/2021	V	9.998,30
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950059	CA.MADRID/6,25 OB SUBD 20120410	10/04/2012	6,250	108.350,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950091	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20130328	28/03/2013	V	100.336,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950109	CA.MADRID/4,00 OB 20110302	02/03/2011	4,000	975,92
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950117	CA.MADRID/3,76 OB 20110331	31/03/2011	3,760	967,21
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950125	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20140715	15/07/2014	V	100.164,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950133	CA.MADRID/VAR OB 20120601	01/06/2012	V	99.884,65
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950141	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20180301	01/03/2018	V	99.460,55
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950158	CA.MADRID/VAR OB 20120209	09/02/2012	V	99.931,58

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950166	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20161017	17/10/2016	V	49.950,40
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950174	CA.MADRID/VAR OB 20140626	26/06/2014	V	991,64
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0214965008	CAN/VAR OB SUBD 20160616	16/06/2016	V	99.789,91
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYEN	ES0214955017	CA.ONTINYENT/VAR OB SUBD 20130528	28/05/2013	V	6.000,03
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYEN	ES0214955025	CA.ONTINYENT/VAR OB SUBD 20160428	28/04/2016	V	5.989,75
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0214959068	CA.SEGOVIA/VAR OB SUBD 20160728	28/07/2016	V	49.936,35
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0214959076	CA.SEGOVIA/VAR OB SUBD 20170620	20/06/2017	V	49.923,69
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ	ES0214954010	IBERCAJA/VAR OB PREF PERP		V	601,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ	ES0214954028	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP		V	601,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ	ES0214954036	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP		V	601,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ	ES0214954044	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP		V	601,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ	ES0214954069	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20140715	15/07/2014	V	494,82
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ	ES0214954135	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20180420	20/04/2018	V	499,11
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ	ES0214954143	IBERCAJA/VAR OB 20120720	20/07/2012	V	99.608,53
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ	ES0214954150	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20190425	25/04/2019	V	499,33
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	1.000,30
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	999,98
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES0215474026	CA.ESPAÑA/5,75 OB SUBD 20150627	27/06/2015	5,750	997,27
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES0215474166	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20181229	29/12/2018	V	995,76
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES0215474190	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20151207	07/12/2015	V	99.753,03
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES0215474208	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20160131	31/01/2016	V	998,06
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES0215474216	CA.ESPAÑA/VAR OB 20130517	17/05/2013	V	99.014,38
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES0215474224	CA.ESPAÑA/VAR OB 20140326	26/03/2014	V	99.962,97
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981013	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD PERP		V	603,47
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981039	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20321015	15/10/2032	V	299,61
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981054	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20200628	28/06/2020	V	299,69
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981070	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20151104	04/11/2015	V	99.880,71
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0214982110	CA.GRANADA/VAR OB SUBD 20150630	30/06/2015	V	100.049,96
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0214982128	CA.GRANADA/VAR OB 20220315	15/03/2022	V	50.000,00
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983019	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP		V	302,31
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983035	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP		V	302,30
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983084	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20120801	01/08/2012	V	599,96
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983092	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20131101	01/11/2013	V	500,00
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983118	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20150412	12/04/2015	V	99.989,97
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983126	LA.CAJA/VAR OB 20111005	05/10/2011	V	99.896,84
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983134	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP		V	49.819,83
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COC	ES0215316029	RURALCAJA/VAR OB SUBD 20151122	22/11/2015	V	99.996,22
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE C	ES0214601017	CAJAMAR/VAR OB SUBD 20150316	16/03/2015	V	99.756,12
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICA DE PROD	ES0224261000	CORES/4,00 OB 20130715	15/07/2013	4,000	96.103,75
DEUTSCHE BANK, A.G.	DE0003933693	OB. DEUTSCHE BANK	10/11/2014	4,155	955,53
DEUTSCHE BANK, SOCIEDAD ANONIMA ESPAÑOLA	ES0213320015	DT.BK.SAE/VAR OB SUBD 20131230	30/12/2013	V	92,19
DEUTSCHE BANK, SOCIEDAD ANONIMA ESPAÑOLA	ES0213320023	DT.BK.SAE/VAR OB SUBD 20140331	31/03/2014	V	91,08
DEUTSCHE BANK, SOCIEDAD ANONIMA ESPAÑOLA	ES0213320031	DT.BK.SAE/VAR OB 20150331	31/03/2015	V	93,08
EKSPORTFINANS A/S	ES0228528016	EKSPORTFINANS/8,40 OB 20161010	10/10/2016	8,400	767,43
ENDESA, S.A.	ES0230670210	ELE/4,20 OB 20090225	25/02/2009	4,200	99.858,88
EROSKI SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429004	EROSKI/VAR OB SUBD PERP		V	25,02
EROSKI SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429038	EROSKI/VAR OB SUBD PERP		V	25,01
FAGOR ELECTRODOMESTICOS, SOCIEDAD COOPERATI	ES0235972009	FAGOR/VAR OB SUBD 1º PERP		V	25,04
FAGOR ELECTRODOMESTICOS, SOCIEDAD COOPERATI	ES0235972017	FAGOR/VAR OB SUBD 2º PERP		V	24,97
IBERDROLA, S.A.	ES0244520138	IBE/6,75 OB 20121215	15/12/2012	6,750	6,10
IBERDROLA, S.A.	ES0244580520	IBE/9,30 OB 20081028	28/10/2008	9,300	644,42
IBERDROLA, S.A.	ES0244580538	IBE/8,65 OB 20081230	30/12/2008	8,650	623.910,66
IBERDROLA, S.A.	ES0244580561	IBE/8,25 OB 20091228	28/12/2009	8,250	6.552,36
IBERDROLA, S.A.	ES0274760075	SALTOS.SIL/6,75 OB 20101101	01/11/2010	6,750	6,16
IBERDROLA, S.A.	ES0274760083	SALTOS.SIL/6,75 OB 20121001	01/10/2012	6,750	6,19
MAPFRE, S.A.	ES0224244055	MAP/6,02 OB 20110712	12/07/2011	6,020	105.312,25
MAPFRE, S.A.	ES0224244063	MAP/VAR OB SUBD 20370724	24/07/2037	V	49.988,44
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNAN	ES0214969000	CA.SAN.FERN/4,50 OB 20080928	28/09/2008	4,500	149.933,84
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNAN	ES0214969034	CA.SAN.FERN/VAR OB SUBD 20080430	30/04/2008	V	299,90
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNAN	ES0217156092	EL.MONTE/VAR OB SUBD PERP		V	99.867,26
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNAN	ES0264870017	EL.MONTE/VAR OB SUBD PERP		V	1.517,80
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE	ES0214920029	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD PERP		V	609,60
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE	ES0214920045	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD PERP		V	600,80
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE	ES0214920052	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD PERP		V	600,88
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE	ES0214920060	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD 20211018	18/10/2021	V	599,85
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE	ES0214920078	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD 20230610	10/06/2023	V	599,90
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE	ES0214920086	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD 20250608	08/06/2025	V	599,84
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE	ES0214920094	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD 20220615	15/06/2022	V	603,76
PASTOR INTERNATIONAL CAPITAL	ES0268649029	PAS.INTL.CAP/VAR OB SUBD 20120315	15/03/2012	V	2.975,94
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0213495007	SAN.CON.S.FIN/VAR OB SUBD 20160928	28/09/2016	V	49.962,63
SWEDISH EXPORT CREDIT CORPORATION	ES0277029130	SEK/VAR OB 20081105	05/11/2008	V	604,31
TELEFONICA, S.A.	ES0278430923	TEF/4,8414 OB 20080303	03/03/2008	4,841	60,18
TELEFONICA, S.A.	ES0278430931	TEF/4,50 OB 20090414	14/04/2009	4,500	10.005,75
UNIVERSIDAD DE ALICANTE	ES0282101007	UNIV.ALI/6,50 OB 20171215	15/12/2017	6,500	6.611,13
UNIVERSIDAD DE VALENCIA - ESTUDI GENERAL	ES0282102005	UNIV.VAL/6,60 OB 20221215	15/12/2022	6,600	6.010,12
UNIVERSIDAD DE VALENCIA - ESTUDI GENERAL	ES0282102013	UNIV.VAL/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	1.000,00

**RENTA FIJA****BONOS**

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ACTUACIONES ACTIVIDADES E INVERSIONES INMOBILIARIAS	ES0306585029	AISA/5,00 BO 20110814	14/08/2011	5,000	961,98
AYT BONOS TESORERIA I, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312348008	AYT.BO.TESOR.I/3,25 BTA 20100406 A	06/04/2010	3,250	97.176,97
AYT BONOS TESORERIA I, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312348016	AYT.BO.TESOR.I/3,25 BTA 20100406 B	06/04/2010	3,250	97.031,37
AYT BONOS TESORERIA I, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312348024	AYT.BO.TESOR.I/3,50 BTA 20100406 C	06/04/2010	3,500	95.609,06
AYT BONOS TESORERIA II, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312271002	AYT.BO.TESOR.II/VAR BTA 20130224 A	24/02/2013	V	99.772,15
AYT BONOS TESORERIA II, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312271010	AYT.BO.TESOR.II/VAR BTA 20130224 B	24/02/2013	V	100.049,55
AYT BONOS TESORERIA II, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312271028	AYT.BO.TESOR.II/VAR BTA 20130224 C	24/02/2013	V	99.976,85
AYT CAJA MURCIA HIPOTECARIO I, FONDO DE TITULIZACION	ES0312282009	AYT.CAMUR.H.I/VAR BTA 20381017 A	17/10/2038	V	70.867,28
AYT CAJA MURCIA HIPOTECARIO I, FONDO DE TITULIZACION	ES0312282017	AYT.CAMUR.H.I/VAR BTA 20381017 B	17/10/2038	V	100.036,03
AYT CAJA MURCIA HIPOTECARIO I, FONDO DE TITULIZACION	ES0312282025	AYT.CAMUR.H.I/VAR BTA 20381017 C	17/10/2038	V	100.045,33
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FONDO DE TITULIZACION	ES0312212006	AYT.CAJAGRA.H.I/VAR BTA 20470309 A	09/03/2047	V	93.222,50
AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION	ES0312272000	AYT.CAMUR.H.II/VAR BTA 20390407 A	07/04/2039	V	86.277,35
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION	ES0312298005	AYT.CCG/VAR BTA 20121214 I GTIA	14/12/2012	V	99.903,16
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION	ES0312298013	AYT.CCG/3,50 BTA 20160314 II GTIA	14/03/2016	3,500	92.693,87
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION	ES0312298021	AYT.CCG/3,75 BTA 20221214 III GTIA	14/12/2022	3,750	87.558,51
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION	ES0312298047	AYT.CCG/3,50 BTA 20110314 V GTIA	14/03/2011	3,500	97.360,94
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION	ES0312298054	AYT.CCG/4,00 BTA 20210324 VI GTIA	24/03/2021	4,000	94.101,55
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION	ES0312298062	AYT.CCG/VAR BTA 20170526 VII GTIA	26/05/2017	V	99.478,19
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION	ES0312298070	AYT.CCG/4,25 BTA 20180614 8 GTIA	14/06/2018	4,250	97.755,15
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION	ES0312298088	AYT.CCG/3,75 BTA 20131025 IX GTIA	25/10/2013	3,750	96.676,05
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION	ES0312298096	AYT.CCG/4,25 BTA 20231025 X GTIA	25/10/2023	4,250	94.925,77
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION	ES0312298104	AYT.CCG/4,00 BTA 20161220 XI GTIA	20/12/2016	4,000	95.910,05
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION	ES0312298112	AYT.CCG/4,00 BTA 20170321 XII GTIA	21/03/2017	4,000	94.326,94
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION	ES0312298120	AYT.CCG/4,00 BTA 20270525 13 GTIA	25/05/2027	4,000	98.931,02
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION	ES0312298138	AYT.CCG/VAR BTA 20190524 XIV GTIA	24/05/2019	V	100.000,00
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION	ES0312298146	AYT.CCG/VAR BTA 20091013 XV GTIA	13/10/2009	V	99.731,35
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION	ES0312298153	AYT.CCG/VAR BTA 20171023 XVI GTIA	23/10/2017	V	99.930,63
AYT CEDULAS CAJAS II, FONDO DE TITULIZACION DE	ES030390304006	AYT.CED.CA.II/4,50 BTA 20081128	28/11/2008	4,500	100.262,38
AYT CEDULAS CAJAS III FONDO DE TITULIZACION DE	ES030361002001	AYT.CED.CA.III/5,25 BTA 20120628	28/06/2012	5,250	104.926,48
AYT CEDULAS CAJAS IV, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312368006	AYT.CED.CA.IV/4,00 BTA 20130313	13/03/2013	4,000	96.778,61
AYT CEDULAS CAJAS IX, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312358007	AYT.CED.CA.IX/3,75 BTA 20150331 A	31/03/2015	3,750	96.200,70
AYT CEDULAS CAJAS IX, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312358015	AYT.CED.CA.IX/4,00 BTA 20200331 B	31/03/2020	4,000	93.078,59
AYT CEDULAS CAJAS V, FONDO DE TITULIZACION DE	ES03070148001	AYT.CED.CA.V/4,50 BTA 20131204 A	04/12/2013	4,500	98.113,47
AYT CEDULAS CAJAS V, FONDO DE TITULIZACION DE	ES03070148019	AYT.CED.CA.V/4,75 BTA 20181204 B	04/12/2018	4,750	101.476,47
AYT CEDULAS CAJAS VI, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312360003	AYT.CED.CA.VI/4,00 BTA 20140407 A	07/04/2014	4,000	95.397,36
AYT CEDULAS CAJAS VII, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312361001	AYT.CED.CA.VII/4,00 BTA 20110623	23/06/2011	4,000	98.468,94
AYT CEDULAS CAJAS VIII, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312362009	AYT.CED.CA.VIII/4,00 BTA 20141118 A	18/11/2014	4,000	97.549,32
AYT CEDULAS CAJAS VIII, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312362017	AYT.CED.CA.VIII/4,25 BTA 20191118 E	18/11/2019	4,250	95.660,85
AYT CEDULAS CAJAS X, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312342001	AYT.CED.CA.X/VAR BTA 20150630 A	30/06/2015	V	99.856,38
AYT CEDULAS CAJAS X, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312342019	AYT.CED.CA.X/3,75 BTA 20250630 B	30/06/2025	3,750	87.405,02
AYT CEDULAS CAJAS XI, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312213004	AYT.CED.CA.XI/VAR BTA 20121127 A	27/11/2012	V	99.993,45
AYT CEDULAS CAJAS, FONDO DE TITULIZACION DE	ES030352961009	AYT.CED.CA/5,25 BTA 201110420	20/04/2011	5,250	103.296,22
AYT CEDULAS TERRITORIALES CAJAS I, FONDO DE	ES03070142004	AYT.CEDTER.CA.I/3,75 BTA 20081024	24/10/2008	3,750	99.472,10
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A	ES0312273008	COLAT.GLB.HIP./VAR BTA 20470322 A	22/03/2047	V	97.421,22
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A	ES0312273123	COLAT.GLB.HIP./VAR BTA 20470516 A	16/05/2047	V	96.594,49
AYT DEUDA SUBORDINADA I, FONDO DE TITULIZACION	ES0312284005	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 A	17/11/2016	V	99.982,83
AYT FONDO EOLICO, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312376009	AYT.EOLICO/VAR BTA 20141125 E1 GTIA	25/11/2014	V	497,72
AYT FONDO EOLICO, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312376017	AYT.EOLICO/VAR BTA 20161229 E2 GTIA	29/12/2016	V	499,58
AYT FTGENCAT I, FONDO DE TITULIZACION DE	ES03056848012	AYT.FTGENCAT.I/VAR BTA 20340905 AF	05/09/2034	V	7.331,32
AYT FTPYME I, FONDO DE TITULIZACION DE	ES03070149009	ATY.FTPYME.I/VAR BTA 20300115 F1	15/01/2030	V	7.691,44
AYT FTPYME I, FONDO DE TITULIZACION DE	ES03070149017	ATY.FTPYME.I/VAR BTA 20300115 F2	15/01/2030	V	54.284,01
AYT FTPYME I, FONDO DE TITULIZACION DE	ES03070149025	ATY.FTPYME.I/VAR BTA 20300115 T2	15/01/2030	V	54.107,67
AYT FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312363007	AYT.FTPYME.II/VAR BTA 20321020 F1	20/10/2032	V	26.779,54
AYT FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312363015	AYT.FTPYME.II/VAR BTA 20321020 F2	20/10/2032	V	100.000,00
AYT FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312363031	AYT.FTPYME.II/VAR BTA 20321020 F3	20/10/2032	V	100.082,04
AYT GENOVA HIPOTECARIO III, FONDO DE TITULIZACION	ES03070143002	AYT.GEN.H.III/VAR BTH 20350715 A	15/07/2035	V	60.721,80
AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, FONDO DE TITULIZACION	ES03070150015	AYT.GEN.H.IV/VAR BTH 20360516 B	16/05/2036	V	100.486,20
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION	ES0312300017	AYT.GEN.H.IX/VAR BTH 20390715 A2	15/07/2039	V	49.356,79
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION	ES0312300033	AYT.GEN.H.IX/VAR BTH 20390715 C	15/07/2039	V	49.869,73
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FONDO DE TITULIZACION	ES0312349014	AYT.GEN.H.VI/VAR BTH 20380115 A2	15/01/2038	V	99.490,28
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION	ES0312343009	AYT.GEN.H.VII/VAR BTH 20380915 A1	15/09/2038	V	7.779,53
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION	ES0312343017	AYT.GEN.H.VII/VAR BTH 20380915 A2	15/09/2038	V	49.979,76
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FONDO DE TITULIZACION	ES0312344007	AYT.GEN.H.VIII/VAR BTH 20390515 A1	15/05/2039	V	15.996,82
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FONDO DE TITULIZACION	ES0312344015	AYT.GEN.H.VIII/VAR BTH 20390515 A2	15/05/2039	V	49.490,31
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FONDO DE TITULIZACION	ES0312301007	AYT.GEN.H.X/VAR BTH 20400315 A1	15/03/2040	V	39.958,06
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FONDO DE TITULIZACION	ES0312301015	AYT.GEN.H.X/VAR BTH 20400315 A2	15/03/2040	V	50.000,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FONDO DE TITULIZACION	ES0312301023	AYT.GEN.H.X/VAR BTH 20400315 B	15/03/2040	V	50.000,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FONDO DE TITULIZACION	ES0312301031	AYT.GEN.H.X/VAR BTH 20400315 C	15/03/2040	V	50.000,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FONDO DE TITULIZACION	ES0312301049	AYT.GEN.H.X/VAR BTH 20400315 D	15/03/2040	V	50.000,00
AYT HIPOTECARIO III, FONDO DE TITULIZACION	ES0312369004	AYT.HIP.III/VAR BTH 20330318 A GTIA	18/03/2033	V	46.432,97
AYT HIPOTECARIO III, FONDO DE TITULIZACION	ES0312369012	AYT.HIP.III/VAR BTH 20330318 B GTIA	18/03/2033	V	102.457,47
AYT HIPOTECARIO IV, FONDO DE TITULIZACION	ES0312370002	AYT.HIP.IV/VAR BTH 20330613 A GTIA	13/06/2033	V	42.148,98
AYT HIPOTECARIO IV, FONDO DE TITULIZACION	ES0312370010	AYT.HIP.IV/VAR BTH 20330613 B GTIA	13/06/2033	V	100.274,09
AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FONDO DE TITULIZACION	ES03070151013	AYT.HIP.MIX.II/VAR BTA 20360620 PH2	20/06/2036	V	99.796,44
AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FONDO DE TITULIZACION	ES03070151039	AYT.HIP.MIX.II/VAR BTA 20360620 CH2	20/06/2036	V	99.785,06
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FONDO DE TITULIZACION	ES0312378005	AYT.HIP.MIX.III/VAR BTA 20380321 A	21/03/2038	V	49.750,57
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FONDO DE TITULIZACION	ES0312378013	AYT.HIP.MIX.III/VAR BTA 20380321 E	21/03/2038	V	99.601,67
AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, FONDO DE TITULIZACION	ES03070152003	AYT.HIP.MIX.IV/VAR BTA 20400120 A	20/01/2040	V	72.666,23
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FONDO DE TITULIZACION	ES0312252002	AYT.HIP.MIX.V/VAR BTA 20410610 A	10/06/2041	V	84.156,81
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FONDO DE TITULIZACION	ES0312252010	AYT.HIP.MIX.V/VAR BTA 20410610 E	10/06/2041	V	100.068,81
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FONDO DE TITULIZACION	ES0312252028	AYT.HIP.MIX.V/VAR BTA 20410610 C	10/06/2041	V	100.096,99
AYT HIPOTECARIO MIXTO, FONDO DE TITULIZACION	ES0312371000	AYT.HIP.MIX/VAR BTA 20330915 A GTIA	15/09/2033	V	34.413,87
AYT HIPOTECARIO MIXTO, FONDO DE TITULIZACION	ES0312371018	AYT.HIP.MIX/VAR BTA 20330915 B GTIA	15/09/2033	V	99.845,06
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FONDO DE TITULIZACION	ES03070153001	AYT.KUTXA.HIP.I/VAR BTA 20410422 A	22/04/2041	V	86.789,92
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION	ES03070154009	KUTXA.HIP.II/VAR BTA 20561015 A	15/10/2056	V	96.072,20
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION	ES03070154017	KUTXA.HIP.II/VAR BTA 20561015 B	15/10/2056	V	99.990,65
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION	ES03070154025	KUTXA.HIP.II/VAR BTA 20561015 C	15/10/2056	V	100.000,00
AYT PRESTAMOS CONSUMO III, FONDO DE TITULIZACION	ES0312372008	AYT.PREST.C.III/VAR BTA 20210115 A	15/01/2021	V	99.460,69
AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS II, FONDO DE TITULIZACION	ES030356850000	AYT.INMO.II/VAR BTA 20401210 1 GTIA	10/12/2040	V	22.226,45
AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS III, FONDO DE TITULIZACION	ES0312379003	AYT.INMO.III/VAR BTA 20461215 A	15/12/2046	V	46.134,84
AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS IV, FONDO DE TITULIZACION	ES0312380001	AYT.INMO.IV/VAR BTA 20371015 1 GTIA	15/10/2037	V	39.767,24
AYT.1, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0338540000	AYT.1/VAR BTH 20281220 A GTIA	20/12/2028	V	21.591,10
AYT.11, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0338541008	AYT.11/VAR BTH 20351015 A GTIA	15/10/2035	V	38.226,30
AYT.11, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0338541016	AYT.11/VAR BTH 20351015 B GTIA	15/10/2035	V	100.273,00
AYT.2, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0312406012	AYT.2/VAR BTH 20321220 A2 GTIA	20/12/2032	V	24.099,91
AYT.7, PROMOCIONES INMOBILIARIAS I, FONDO DE TITULIZACION	ES030390305003	AYT.7.INMO.I/VAR BTA 20350616 GTIA	16/06/2035	V	15.555,52

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCAJA 10, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312872007	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 A1 GTIA	22/05/2050	V	40.407,51
BANCAJA 10, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312872015	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 A2 GTIA	22/05/2050	V	99.970,16
BANCAJA 10, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312872023	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 A3 GTIA	22/05/2050	V	100.000,00
BANCAJA 10, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312872031	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 B GTIA	22/05/2050	V	100.000,00
BANCAJA 10, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312872049	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 C GTIA	22/05/2050	V	100.011,11
BANCAJA 10, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312872056	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 D GTIA	22/05/2050	V	100.000,00
BANCAJA 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312867007	BANCAJA.11/VAR BTA 20500427 A1 GTIA	27/04/2050	V	82.586,98
BANCAJA 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312867015	BANCAJA.11/VAR BTA 20500427 A2 GTIA	27/04/2050	V	99.925,59
BANCAJA 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312867023	BANCAJA.11/VAR BTA 20500427 A3 GTIA	27/04/2050	V	99.962,50
BANCAJA 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312867031	BANCAJA.11/VAR BTA 20500427 B GTIA	27/04/2050	V	99.960,00
BANCAJA 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312867049	BANCAJA.11/VAR BTA 20500427 C GTIA	27/04/2050	V	99.959,50
BANCAJA 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312867056	BANCAJA.11/VAR BTA 20500427 D GTIA	27/04/2050	V	99.960,00
BANCAJA 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312882022	BANCAJA.3/6,75 BTA 20340623 C GTIA	23/06/2034	6,750	107.690,00
BANCAJA 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312885017	BANCAJA.6/VAR BTA 20360220 A2 GTIA	20/02/2036	V	41.105,72
BANCAJA 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312885025	BANCAJA.6/VAR BTA 20360220 B GTIA	20/02/2036	V	84.429,98
BANCAJA 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312886015	BANCAJA.7/VAR BTA 20361125 A2 GTIA	25/11/2036	V	54.626,73
BANCAJA 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312886023	BANCAJA.7/VAR BTA 20361125 B GTIA	25/11/2036	V	100.404,26
BANCAJA 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312887005	BANCAJA.8/VAR BTA 20371025 A GTIA	25/10/2037	V	58.134,28
BANCAJA 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312887013	BANCAJA.8/VAR BTA 20371025 B GTIA	25/10/2037	V	99.675,00
BANCAJA 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312888011	BANCAJA.9/VAR BTA 20430925 A2 GTIA	25/09/2043	V	78.717,76
BANCAJA 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312888029	BANCAJA.9/VAR BTA 20430925 B GTIA	25/09/2043	V	99.875,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A	ES0313211130	BBVA/VAR BO 20090226	26/02/2009	V	99.730,87
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A	ES0313211148	BBVA/VAR BO 20080616	16/06/2008	V	99.781,46
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A	ES0313211171	BBVA/4,125 BO 20111220	20/12/2011	4,125	50.173,01
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A	ES0313211213	BBVA/VAR BO 20110622	22/06/2011	V	49.924,03
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0313377006	BCO.COOP.ESP./VAR BO 20090126	26/01/2009	V	99.842,95
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0300230051	BCO.CTO.LOCAL/VAR BO 20090224	24/02/2009	V	99.974,30
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860092	SAB/VAR BO 20100920	20/09/2010	V	99.711,45
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860118	SAB/VAR BO 20080310	10/03/2008	V	99.942,44
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860126	SAB/VAR BO 20090707	07/07/2009	V	99.674,45
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860134	SAB/VAR BO 20111026	26/10/2011	V	99.664,64
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860142	SAB/VAR BO 20080618	18/06/2008	V	99.807,85
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860159	SAB/VAR BO 20081211	11/12/2008	V	99.957,92
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0313980015	BVA/VAR BO 20110721	21/07/2011	V	49.943,99
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0313980023	BVA/VAR BO 20120223	23/02/2012	V	49.952,52
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0313440119	BTO/VAR BO 20090610	10/06/2009	V	99.875,41
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0313440135	BTO/VAR BO 20081028	28/10/2008	V	99.919,45
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0313580112	GUI/5,75 BO SUBD 20090415	15/04/2009	5,750	607,10
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0313580120	GUI/VAR BO 20110321	21/03/2011	V	99.767,09
BANCO PASTOR, S.A.	ES0313770069	PAS/VAR BO 20100121	21/01/2010	V	100.275,89
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0313260053	BCH/VAR BO SUBD 20110527	27/05/2011	V	7,23
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0313900344	SAN/VAR BO 20090316	16/03/2009	V	99.957,24
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0313540025	BBE/VAR BO 20100222	22/02/2010	V	99.476,21
BANKINTER 1, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313799001	BKT.1/VAR BTH 20240422 A GTIA	22/04/2024	V	19.064,68
BANKINTER 10, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313529010	BKT.10/VAR BTA 20430621 A2 GTIA	21/06/2043	V	75.731,14
BANKINTER 11, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313714018	BKT.11/VAR BTH 20480821 A2 GTIA	21/08/2048	V	82.848,80
BANKINTER 11, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313714026	BKT.11/VAR BTH 20480821 B GTIA	21/08/2048	V	100.099,20
BANKINTER 12, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313715015	BKT.12/VAR BTH 20431215 A2 GTIA	15/12/2043	V	84.212,15
BANKINTER 13 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313270011	BKT.13/VAR BTA 20490717 A2 GTIA	17/07/2049	V	99.580,20
BANKINTER 13 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313270037	BKT.13/VAR BTA 20490717 C GTIA	17/07/2049	V	100.021,54
BANKINTER 2 PYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313716013	BKT.2.PYME/VAR BTA 20430516 A2 GTIA	16/05/2043	V	78.149,27
BANKINTER 2 PYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313716021	BKT.2.PYME/VAR BTA 20430516 B GTIA	16/05/2043	V	99.955,91
BANKINTER 2 PYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313716039	BKT.2.PYME/VAR BTA 20430516 C GTIA	16/05/2043	V	99.978,58
BANKINTER 2, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313800031	BKT.2/VAR BTH 20340722 A4 GTIA	22/07/2034	V	39.150,15
BANKINTER 3 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313273023	BKT.3.PYME/VAR BTA 20460218 A3G	18/02/2046	V	99.970,00
BANKINTER 3, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0314019003	BKT.3/VAR BTH 20381016 A GTIA	16/10/2038	V	38.680,27
BANKINTER 4, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313919005	BKT.4/VAR BTH 20381112 A GTIA	12/11/2038	V	47.499,77
BANKINTER 5, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313920003	BKT.5/VAR BTH 20391112 A GTIA	12/11/2039	V	45.751,13
BANKINTER 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313546006	BKT.6/VAR BTA 20380826 A GTIA	26/08/2038	V	56.504,68
BANKINTER 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313546014	BKT.6/VAR BTA 20380826 B GTIA	26/08/2038	V	99.700,00
BANKINTER 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313548002	BKT.8/VAR BTA 20401215 A GTIA	15/12/2040	V	56.890,30
BANKINTER 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313548028	BKT.8/VAR BTA 20401215 C GTIA	15/12/2040	V	102.109,75
BANKINTER 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313814016	BKT.9/VAR BTA 20420716 A2P GTIA	16/07/2042	V	77.142,30
BANKINTER 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313814032	BKT.9/VAR BTA 20420716 CP GTIA	16/07/2042	V	100.429,23
BANKINTER 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313814057	BKT.9/VAR BTA 20420716 A2T GTIA	16/07/2042	V	80.075,57
BANKINTER 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313814065	BKT.9/VAR BTA 20420716 BT GTIA	16/07/2042	V	100.557,71
BANKINTER 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313814073	BKT.9/VAR BTA 20420716 CT GTIA	16/07/2042	V	102.979,52
BANKINTER I FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313922017	BKT.I.PYME/VAR BTA 20300315 T2 GTIA	15/03/2030	V	18.537,40
BANKINTER, S.A.	ES0313679419	BKT/VAR BO 20081010	10/10/2008	V	99.825,16
BANKINTER, S.A.	ES0313679427	BKT/VAR BO 20101118	18/11/2010	V	99.741,76
BANKINTER, S.A.	ES0313679435	BKT/VAR BO 20110601	01/06/2011	V	99.887,59
BANKINTER, S.A.	ES0313679443	BKT/VAR BO 20120621	21/06/2012	V	99.975,86
BBVA AUTOS 1 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314204001	BBVA.AUTOS.1/VAR BTA 20160620 A	20/06/2016	V	53.585,28
BBVA AUTOS 2 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0333761007	BBVA.AUTOS.2/VAR BTA 20191120 A	20/11/2019	V	99.829,93
BBVA CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0333763003	BBVA.CONSUMO.1/VAR BTA 20200120 A	20/01/2020	V	99.847,84
BBVA CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313956007	BBVA.CONSUMO.2/VAR BTA 20201220 A	20/12/2020	V	99.616,87
BBVA CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313956023	BBVA.CONSUMO.2/VAR BTA 20201220 C	20/12/2020	V	100.030,39
BBVA EMPRESAS 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313820005	BBVA.EMP.1/VAR BTA 20470722 A1 GTIA	22/07/2047	V	100.000,00
BBVA EMPRESAS 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313820013	BBVA.EMP.1/VAR BTA 20470722 A2 GTIA	22/07/2047	V	100.000,00
BBVA FINANZIA AUTOS 1 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313958003	FINAZ.AUTOS.1/VAR BTA 20210426 A	26/04/2021	V	99.924,79
BBVA FINANZIA AUTOS 1 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313958011	FINAZ.AUTOS.1/VAR BTA 20210426 B	26/04/2021	V	100.000,00
BBVA FINANZIA AUTOS 1 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313958029	FINAZ.AUTOS.1/VAR BTA 20210426 C	26/04/2021	V	100.000,00
BBVA HIPOTECARIO 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314227010	BBVA.HIP.3/VAR BTA 20381121 A2 GTIA	21/11/2038	V	81.806,50
BBVA HIPOTECARIO 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314227028	BBVA.HIP.3/VAR BTA 20381121 B GTIA	21/11/2038	V	98.750,00
BBVA LEASING 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314209000	BBVA.LEASING.1/VAR BTA 20310526 A1	26/05/2031	V	99.877,28
BBVA LEASING 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314209018	BBVA.LEASING.1/VAR BTA 20310526 A2	26/05/2031	V	99.226,56
BBVA LEASING 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314209026	BBVA.LEASING.1/VAR BTA 20310526 B	26/05/2031	V	99.584,57
BBVA LEASING 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314209034	BBVA.LEASING.1/VAR BTA 20310526 C	26/05/2031	V	100.000,00
BBVA RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314147002	BBVA.RMBS1/VAR BTA 20500619 A1 GTIA	19/06/2050	V	42.622,70
BBVA RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314147010	BBVA.RMBS1/VAR BTA 20500619 A2 GTIA	19/06/2050	V	99.894,98
BBVA RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314147036	BBVA.RMBS1/VAR BTA 20500619 B GTIA	19/06/2050	V	99.999,89
BBVA RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314147044	BBVA.RMBS1/VAR BTA 20500619 C GTIA	19/06/2050	V	100.000,00
BBVA RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314148000	BBVA.RMBS2/VAR BTA 20500917 A1 GTIA	17/09/2050	V	56.405,03
BBVA RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314148018	BBVA.RMBS2/VAR BTA 20500917 A2 GTIA	17/09/2050	V	99.232,52
BBVA RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314148026	BBVA.RMBS2/VAR BTA 20500917 A3 GTIA	17/09/2050	V	100.000,00
BBVA RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314148034	BBVA.RMBS2/VAR BTA 20500917 A4 GTIA	17/09/2050	V	100.000,00



Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BBVA RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314148042	BBVA.RMBS2/VAR BTA 20500917 B GTIA	17/09/2050	V	100.000,00
BBVA RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314148059	BBVA.RMBS2/VAR BTA 20500917 C GTIA	17/09/2050	V	99.942,62
BBVA RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314149008	BBVA.RMBS3/VAR BTA 20600220 A1 GTIA	20/02/2060	V	94.495,72
BBVA RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314149016	BBVA.RMBS3/VAR BTA 20600220 A2 GTIA	20/02/2060	V	100.000,00
BBVA-3 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0310110004	BBVA3-PYME/VAR BTA 20280421 A1 GTIA	21/04/2028	V	20.506,62
BBVA-3 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0310110012	BBVA3-PYME/VAR BTA 20280421 A2G	21/04/2028	V	99.964,37
BBVA-3 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0310110038	BBVA3-PYME/VAR BTA 20280421 C GTIA	21/04/2028	V	82.931,76
BBVA-4 PYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370458012	BBVA4.PYME/VAR BTA 20380819 A2 GTIA	19/08/2038	V	55.355,64
BBVA-4 PYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370458020	BBVA4.PYME/VAR BTA 20380819 B GTIA	19/08/2038	V	88.170,89
BBVA-4 PYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370458038	BBVA4.PYME/VAR BTA 20380819 C GTIA	19/08/2038	V	87.826,95
BBVA-5 FTPYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370459002	BBVA5.PYME/VAR BTA 20390315 A1 GTIA	15/03/2039	V	62.691,03
BBVA-6 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370460000	BBVA6.PYME/VAR BTA 20460322 A1	22/03/2046	V	84.582,58
BBVA-6 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370460018	BBVA6.PYME/VAR BTA 20460322 A2G	22/03/2046	V	100.000,00
BBVA-6 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370460034	BBVA6.PYME/VAR BTA 20460322 C	22/03/2046	V	99.612,94
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080011	BPEF/VAR BO 20090730	30/07/2009	V	100.026,40
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080037	BPEF/VAR BO 20080208	08/02/2008	V	99.975,36
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080052	BPEF/VAR BO 20100526	26/05/2010	V	99.752,21
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080078	BPEF/VAR BO 20080908	08/09/2008	V	99.699,54
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080086	BPEF/VAR BO 20110118	18/01/2011	V	99.873,14
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080094	BPEF/VAR BO 20090210	10/02/2009	V	99.926,22
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080110	BPEF/VAR BO 20090522	22/05/2009	V	99.821,36
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080128	BPEF/VAR BO 20080128	28/01/2008	V	100.000,00
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080136	BPEF/VAR BO 20100728	28/07/2010	V	99.319,85
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080144	BPEF/VAR BO 20120208	08/02/2012	V	99.987,60
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080151	BPEF/VAR BO 20080922	22/09/2008	V	99.998,65
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080169	BPEF/VAR BO 20100726	26/07/2010	V	99.826,05
BZ HIPOTECARIO 1 FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0315271009	BZ.HIP.1/VAR BTH 20240317 A GTIA	17/03/2024	V	11.256,56
BZ HIPOTECARIO 1 FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0315271017	BZ.HIP.1/VAR BTH 20240317 B GTIA	17/03/2024	V	100.000,72
BZ HIPOTECARIO 2 FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0369069002	BZ.HIP.2/VAR BTH 20250517 A GTIA	17/05/2025	V	16.206,35
BZ HIPOTECARIO 2 FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0369069010	BZ.HIP.2/VAR BTH 20250517 B GTIA	17/05/2025	V	31.207,42
BZ HIPOTECARIO 3 FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0315189003	BZ.HIP.3/VAR BTH 20270417 A GTIA	17/04/2027	V	25.559,82
BZ HIPOTECARIO 3 FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0315189011	BZ.HIP.3/VAR BTH 20270417 B GTIA	17/04/2027	V	48.979,67
BZ HIPOTECARIO 3 FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0315189029	BZ.HIP.3/VAR BTH 20270417 C GTIA	17/04/2027	V	100.000,00
BZ HIPOTECARIO 4 FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0305571004	BZ.HIP.4/VAR BTH 20321018 A GTIA	18/10/2032	V	33.938,87
BZ HIPOTECARIO 4 FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0305571012	BZ.HIP.4/VAR BTH 20321018 B GTIA	18/10/2032	V	69.506,54
BZ HIPOTECARIO 4 FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0305571020	BZ.HIP.4/VAR BTH 20321018 C GTIA	18/10/2032	V	70.215,79
CABILDO INSULAR DE GRAN CANARIA	ES0315301046	CBDO.G.C/0,75 BO 20081219	19/12/2008	0,750	992,64
CABILDO INSULAR DE GRAN CANARIA	ES0315301053	CBDO.G.C/0,75 BO 20091210	10/12/2009	0,750	999,96
CABILDO INSULAR DE GRAN CANARIA	ES0315301079	CBDO.G.C/0,75 BO 20111124	24/11/2011	0,750	999,63
CABILDO INSULAR DE TENERIFE	ES0301330082	CBDO.TEN/0,75 BO 20121214	14/12/2012	0,750	1.000,00
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA	ES0314958010	CAIXANOVA/VAR BO 20101123	23/11/2010	V	99.782,93
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA	ES0314958028	CAIXANOVA/VAR BO 20110314	14/03/2011	V	49.853,94
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA	ES0314958036	CAIXANOVA/VAR BO 20120302	02/03/2012	V	49.972,61
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840051	CA.CATALUNYA/VAR BO 20091201	01/12/2009	V	99.655,58
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840077	CA.CATALUNYA/VAR BO 20100302	02/03/2010	V	99.042,64
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840085	CA.CATALUNYA/VAR BO 20080921	21/09/2008	V	100.050,00
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840093	CA.CATALUNYA/VAR BO 20101006	06/10/2010	V	99.024,63
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840101	CA.CATALUNYA/VAR BO 20110718	18/07/2011	V	99.782,77
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840135	CA.CATALUNYA/4,00 BO 20081215	15/12/2008	4,000	50.000,00
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840143	CA.CATALUNYA/VAR BO 20100125	25/01/2010	V	50.020,43
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840150	CA.CATALUNYA/VAR BO 20090216	16/02/2009	V	49.922,65
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0313249007	CA.GIRONA/VAR BO 20120322	22/03/2012	V	49.955,16
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0313249015	CA.GIRONA/VAR BO 20090606	06/06/2009	V	99.922,00
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0313249023	CA.GIRONA/VAR BO 20100628	28/06/2010	V	49.959,14
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0315346009	CA.TARRAGONA/VAR BO 20110411	11/04/2011	V	99.758,64
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0314974033	CA.TERRASSA/VAR BO 20120725	25/07/2012	V	99.851,70
CAIXA PENEDES 1 TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313252001	CA.PENEDES1.TDA/VAR BTA 20430128 A	28/01/2043	V	87.935,31
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0357326000	PENEDES.PYMES.1/VAR BTA 20450928 A	28/09/2045	V	92.015,62
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0357326018	PENEDES.PYMES.1/VAR BTA 20450928 B	28/09/2045	V	99.625,70
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0357326026	PENEDES.PYMES.1/VAR BTA 20450928 C	28/09/2045	V	100.000,00
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843170	CAIXAGALICIA/3,25 BO 20080401	01/04/2008	3,250	494,45
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843188	CAIXAGALICIA/3,25 BO 20080801	01/08/2008	3,250	492,55
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843196	CAIXAGALICIA/3,25 BO 20090902	02/09/2009	3,250	483,71
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843204	CAIXAGALICIA/2,60 BO 20081115	15/11/2008	2,600	484,07
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843212	CAIXAGALICIA/VAR BO 20101129	29/11/2010	V	99.729,55
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843220	CAIXAGALICIA/VAR BO 20090508	08/05/2009	V	49.941,82
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843238	CAIXAGALICIA/VAR BO 20111108	08/11/2011	V	49.866,42
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES0315530032	CA.RIOJA/VAR BO 20100315	15/03/2010	V	97.136,62
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES0315530040	CA.RIOJA/VAR BO 20120222	22/02/2012	V	99.862,52
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0314975006	CA.CANTABRIA/VAR BO 20100406	06/04/2010	V	98.093,70
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0314975014	CA.CANTABRIA/VAR BO 20110330	30/03/2011	V	48.849,16
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0314975022	CA.CANTABRIA/VAR BO 20120412	12/04/2012	V	49.978,26
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICIA	ES0314977101	BANCAJA/3,95 BO 20110430	30/04/2011	3,950	593,48
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICIA	ES0314977119	BANCAJA/3,95 BO 20110601	01/06/2011	3,950	592,67
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICIA	ES0314977168	BANCAJA/VAR BO 20100110	10/01/2010	V	603,73
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICIA	ES0314977200	BANCAJA/VAR BO 20090227	27/02/2009	V	9.961,63
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICIA	ES0314977218	BANCAJA/VAR BO 20100225	25/02/2010	V	99.336,58
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICIA	ES0314977226	BANCAJA/VAR BO 20081110	10/11/2008	V	99.780,96
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICIA	ES0314977242	BANCAJA/VAR BO 20110510	10/05/2011	V	98.785,56
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICIA	ES0314977259	BANCAJA/VAR BO 20120124	24/01/2012	V	99.888,65
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICIA	ES0314977267	BANCAJA/VAR BO 20120321	21/03/2012	V	99.862,00
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0315308124	CA.VITAL/VAR BO 20080930	30/09/2008	V	1.002,45
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0315308140	CA.VITAL/VAR BO 20080724	24/07/2008	V	100.005,72
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0315308157	CA.VITAL/VAR BO 20090403	03/04/2009	V	100.000,00
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400047	CAM/VAR BO 20090615	15/06/2009	V	99.734,08
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400054	CAM/VAR BO 20100114	14/01/2010	V	99.650,97
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400062	CAM/VAR BO 20110203	03/02/2011	V	99.663,73
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400070	CAM/VAR BO 20120515	15/05/2012	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400088	CAM/VAR BO 20120412	12/04/2012	V	99.997,33
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES0314961030	CA.BURGOS/VAR BO 20090309	09/03/2009	V	99.878,00
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES0314961048	CA.BURGOS/VAR BO 20100202	02/02/2010	V	99.714,23
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES0314961055	CA.BURGOS/VAR BO 20080409	09/04/2008	V	99.977,32
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES0314961063	CA.BURGOS/VAR BO 20110131	31/01/2011	V	99.946,04
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0314910029	CA.AVILA/VAR BO 20100629	29/06/2010	V	49.957,50
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950074	CA.MADRID/4,9089 BO SUBD 20100406	06/04/2010	4,909	602,65

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950082	CA.MADRID/4,00 BO 20081006	06/10/2008	4,000	595,76
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950140	CA.MADRID/4,00 BO 20090211	11/02/2009	4,000	987,79
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950157	CA.MADRID/VAR BO 20090331	31/03/2009	V	983,20
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950181	CA.MADRID/VAR BO 20090810	10/08/2009	V	992,80
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950207	CA.MADRID/VAR BO 20080221	21/02/2008	V	99.872,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950215	CA.MADRID/VAR BO 20100323	23/03/2010	V	99.698,37
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950231	CA.MADRID/VAR BO 20081003	03/10/2008	V	99.872,53
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950249	CA.MADRID/CUPCER BO 20090217	17/02/2009	C	944,17
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950256	CA.MADRID/VAR BO 20090217	17/02/2009	V	962,91
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950264	CA.MADRID/VAR BO 20090223	23/02/2009	V	99.755,13
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950280	CA.MADRID/VAR BO 20100524	24/05/2010	V	99.900,57
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950298	CA.MADRID/VAR BO 20090629	29/06/2009	V	49.950,81
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950306	CA.MADRID/4,25 BO 20120626	26/06/2012	4,250	994,03
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ	ES0314954050	IBERCAJA/VAR BO 20090203	03/02/2009	V	99.901,05
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ	ES0314954068	IBERCAJA/VAR BO 20110209	09/02/2011	V	99.617,84
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO	ES0315134009	CAJACIRCULO/VAR BO 20120308	08/03/2012	V	49.965,45
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0314970015	LACAIXA/VAR BO 20090302	02/03/2009	V	99.790,90
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0314970023	LACAIXA/VAR BO 20080314	14/03/2008	V	99.907,55
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0314970031	LACAIXA/VAR BO 20091122	20/11/2009	V	99.750,40
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0314970056	LACAIXA/VAR BO 20081220	22/12/2008	V	49.988,38
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0314970064	LACAIXA/VAR BO 20090126	26/01/2009	V	99.781,81
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0314970072	LACAIXA/VAR BO 20090413	13/04/2009	V	49.959,68
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0314970080	LACAIXA/VAR BO 20090529	29/05/2009	V	50.000,00
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES0315474389	CA.ESPAÑA/VAR BO 20090818	18/08/2009	V	990,11
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES0315474405	CA.ESPAÑA/VAR BO 20110430	30/03/2010	V	985,47
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES0315474421	CA.ESPAÑA/VAR BO 20101214	14/12/2010	V	99.915,20
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES0315474439	CA.ESPAÑA/VAR BO 20091019	19/10/2009	V	49.970,37
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES0315474447	CA.ESPAÑA/VAR BO 20121122	22/11/2012	V	996,51
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0314982002	CA.GRANADA/VAR BO 20120308	08/03/2012	V	49.957,42
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0314983000	LA.CAJA/VAR BO 20091005	05/10/2009	V	99.965,13
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0314983018	LA.CAJA/VAR BO 20080428	28/04/2008	V	100.004,28
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0314983026	LA.CAJA/VAR BO 20100915	15/09/2010	V	49.982,50
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0314983034	LA.CAJA/VAR BO 20080921	21/09/2008	V	99.988,96
CAJA LABORAL POPULAR COOP. DE CREDITO	ES0315462053	CA.LABORAL/VAR BO 20090713	13/07/2009	V	50.139,60
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0315306003	CR.NAVARRA/VAR BO 20111124	24/11/2011	V	49.967,50
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP	ES0315316002	RURALCAJA/VAR BO 20100926	26/09/2010	V	99.856,73
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CES	ES0314601008	CAJAMAR/VAR BO 20091222	22/12/2009	V	100.120,00
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CES	ES0314601016	CAJAMAR/VAR BO 20110714	14/07/2011	V	49.729,15
CAP-TDA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0315911000	CAP-TDA.1/VAR BTA 20130912 GTIA	12/09/2013	V	100.339,93
CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 2, FONDO DE TITUL	ES0318821008	CED.POP.2/3,75 BTA 20110412 GTIA	12/04/2011	3,750	97.775,38
CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, FONDO DE TITUL	ES0318822006	CED.POP.3/4,25 BTA 20170426 GTIA	26/04/2017	4,250	97.962,56
CEDULAS TDA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317018002	CED.TDA.1/3,25 BTA 20100619 1 GTIA	19/06/2010	3,250	96.997,22
CEDULAS TDA 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317019000	CED.TDA.2/4,50 BTA 20131126 GTIA	26/11/2013	4,500	98.667,44
CEDULAS TDA 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317043000	CED.TDA.3/4,38 BTA 20160303 1 GTIA	03/03/2016	4,375	97.423,82
CEDULAS TDA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317044008	CED.TDA.4/3,63 BTA 20090616 GTIA	16/06/2009	3,625	98.905,84
CEDULAS TDA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317045005	CED.TDA.5/4,13 BTA 20191129 A GTIA	29/11/2019	4,125	95.765,84
CEDULAS TDA 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317046003	CED.TDA.6/3,88 BTA 20250523 GTIA	23/05/2025	3,875	88.856,58
CEDULAS TDA 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317047001	CED.TDA.7/3,50 BTA 20170620 GTIA	20/06/2017	3,500	90.651,58
CIBELES III FTPYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0325593004	CIBELESIII.PYME/VAR BTA 20301126 A	26/11/2030	V	2.711,03
CIBELES III FTPYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0325593012	CIBELESIII.PYME/VAR BTA 20301126 BC	26/11/2030	V	100.603,82
CIBELES III FTPYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0325593020	CIBELESIII.PYME/VAR BTA 20301126 BE	26/11/2030	V	100.600,00
CM BANCAJA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0379349006	CM BANCAJA 1/VAR BTA 20361222 A	22/12/2036	V	48.267,83
CM BANCAJA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0379349014	CM BANCAJA 1/VAR BTA 20361222 B	22/12/2036	V	99.635,80
CM BANCAJA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0379349022	CM BANCAJA 1/VAR BTA 20361222 C	22/12/2036	V	97.488,34
CONSUMO BANCAJA 1, FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0323633000	CONS.BANCAJA.1/VAR BTA 20200526 A	26/05/2020	V	99.723,64
EDT FTPYME PASTOR 3, FONDO DE TITULIZACION DE A	ES0328421005	EDT.PYME.PAS.3/VAR BTA 20390119 A1	19/01/2039	V	27.780,84
EDT FTPYME PASTOR 3, FONDO DE TITULIZACION DE A	ES0328421039	EDT.PYME.PAS.3/VAR BTA 20390119 C	19/01/2039	V	99.080,30
EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 3, FONDO DE TITUL	ES0330876006	TDA.CAM.3/VAR BTA 20400128 A1 GTIA	28/01/2040	V	34.013,79
EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 3, FONDO DE TITUL	ES0330876014	TDA.CAM.3/VAR BTA 20400128 A2 GTIA	28/01/2040	V	100.051,76
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0330991003	ELE.CAP/VAR BO 20120705	05/07/2012	V	49.586,55
ENTE PUBLICO RTVE	ES0331163081	RTVE/VAR BO 20081204	04/12/2008	V	200.226,00
ENTE PUBLICO RTVE	ES0331163115	RTVE/VAR BO 20090509	09/05/2009	V	199.226,39
F.T.A. PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZ. DE CED	ES0334699008	PRG.IND.CED.HIP/5,125 BTA 20220720	20/07/2022	5,125	99.744,71
FINANCIACION BANESTO 1, FONDO DE TITULIZACION D	ES0337648002	FINAN.BTO.1/VAR BTA 20191019 A GTIA	19/10/2019	V	98.728,59
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS BBVA-1	ES0338619028	BBVA-1/VAR BTH 20090831 C GTIA	31/08/2009	V	117.840,89
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS CONSUMO SANT	ES0338300017	CONSUMO.SAN.IVAR BTA 20121115 B	15/11/2012	V	100.341,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS CONSUMO SANT	ES0338300025	CONSUMO.SAN.IVAR BTA 20121115 C	15/11/2012	V	100.622,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS FTPYME SANTA	ES0339773022	PYME.SAN.1/VAR BTA 20341115 B2	15/11/2034	V	100.649,86
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS FTPYME SANTA	ES0338048020	PYME.SAN.2/VAR BTA 20370418 C GTIA	18/04/2037	V	100.800,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER AU	ES0382040006	SAN.AUTO1/VAR BTA 20211125 GTIA	25/11/2021	V	47.905,96
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER COI	ES0337943049	SAN.AUTO.07-2/VAR BTA 20220820 E	20/08/2022	V	100.000,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER COI	ES0338057005	SAN.CONS.AUTO06/VAR BTA 20161020 A	20/10/2016	V	99.610,15
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER COI	ES0338057013	SAN.CONS.AUTO06/VAR BTA 20161020 B	20/10/2016	V	99.940,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER COI	ES0337709002	SAN.AUTO.07-1/VAR BTA 20220920 A	20/09/2022	V	99.887,19
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER COI	ES0337709010	SAN.AUTO.07-1/VAR BTA 20220920 B	20/09/2022	V	99.932,76
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER COI	ES0337709036	SAN.AUTO.07-1/VAR BTA 20220920 D	20/09/2022	V	100.000,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMI	ES0338058003	SAN.EMPR.2/VAR BTA 20500623 A1 GTIA	23/06/2050	V	42.161,47
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMI	ES0338058011	SAN.EMPR.2/VAR BTA 20500623 A2 GTIA	23/06/2050	V	99.616,56
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMI	ES0338058029	SAN.EMPR.2/VAR BTA 20500623 B GTIA	23/06/2050	V	100.120,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMI	ES0338058037	SAN.EMPR.2/VAR BTA 20500623 C GTIA	23/06/2050	V	100.383,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMI	ES0338058045	SAN.EMPR.2/VAR BTA 20500623 D GTIA	23/06/2050	V	100.045,65
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMI	ES0338058052	SAN.EMPR.2/VAR BTA 20500623 E GTIA	23/06/2050	V	99.992,44
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER FIN	ES0382043000	SAN.FINAN.1/VAR BTA 20350720 A GTIA	20/07/2035	V	99.614,31
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER FIN	ES0382043018	SAN.FINAN.1/VAR BTA 20350720 B GTIA	20/07/2035	V	100.053,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER FIN	ES0382043026	SAN.FINAN.1/VAR BTA 20350720 C GTIA	20/07/2035	V	100.053,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER FIN	ES0382043034	SAN.FINAN.1/VAR BTA 20350720 D GTIA	20/07/2035	V	100.064,97
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIP	ES0382042002	SAN.HIP.2/VAR BTA 20490118 A GTIA	18/01/2049	V	81.937,96
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIP	ES0382042010	SAN.HIP.2/VAR BTA 20490118 B GTIA	18/01/2049	V	100.105,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIP	ES0382042028	SAN.HIP.2/VAR BTA 20490118 C GTIA	18/01/2049	V	100.424,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIP	ES0382042036	SAN.HIP.2/VAR BTA 20490118 D GTIA	18/01/2049	V	100.067,73
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIP	ES0382042044	SAN.HIP.2/VAR BTA 20490118 E GTIA	18/01/2049	V	100.000,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIP	ES0338093000	SAN.HIP.3/VAR BTA 20500118 A1 GTIA	18/01/2050	V	79.196,11
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIP	ES0338093018	SAN.HIP.3/VAR BTA 20500118 A2 GTIA	18/01/2050	V	99.962,34
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIP	ES0338093026	SAN.HIP.3/VAR BTA 20500118 A3 GTIA	18/01/2050	V	100.000,00

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIP	ES0338093034	SAN.HIP.3/VAR BTA 20500118 B GTIA	18/01/2050	V	100.000,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIP	ES0338093042	SAN.HIP.3/VAR BTA 20500118 C GTIA	18/01/2050	V	100.000,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIP	ES0338093067	SAN.HIP.3/VAR BTA 20500118 E GTIA	18/01/2050	V	100.000,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 11	ES0338340005	UCI.11/VAR BTA 20410915 A GTIA	15/09/2041	V	42.018,97
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 11	ES0338340021	UCI.11/VAR BTA 20410915 C GTIA	15/09/2041	V	99.776,08
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 14	ES0338341003	UCI.14/VAR BTA 20430620 A GTIA	20/06/2043	V	61.331,88
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 14	ES0338341029	UCI.14/VAR BTA 20430620 C GTIA	20/06/2043	V	99.202,54
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 16	ES0338186009	UCI.16/VAR BTA 20490616 A1 GTIA	16/06/2049	V	33.207,59
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 16	ES0338186010	UCI.16/VAR BTA 20490616 A2 GTIA	16/06/2049	V	100.005,71
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 6	ES0338558002	UCI.6/VAR BTA 20301116 A GTIA	16/11/2030	V	19.767,36
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 9	ES0338222005	UCI.9/VAR BTA 20350619 A GTIA	19/06/2035	V	29.103,09
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 9	ES0338222013	UCI.9/VAR BTA 20350619 B GTIA	19/06/2035	V	61.183,91
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, HIPOTEBANSA 1	ES0338447008	HIPOTEBANSA.11/VAR BTA 20350215 A	15/02/2035	V	41.037,25
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, HIPOTEBANSA 1	ES0338356001	HIPOTEBANSA X/VAR BTA 20340318 A	18/03/2034	V	31.262,85
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, HIPOTEBANSA 1	ES0338356019	HIPOTEBANSA X/VAR BTA 20340318 B	18/03/2034	V	99.811,35
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, SANTANDER EM	ES0382041012	SAN.EMPR.1/VAR BTA 20381104 A2 GTIA	04/11/2038	V	94.915,86
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, SANTANDER EM	ES0382041020	SAN.EMPR.1/VAR BTA 20381104 B GTIA	04/11/2038	V	100.057,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, SANTANDER EM	ES0382041038	SAN.EMPR.1/VAR BTA 20381104 C GTIA	04/11/2038	V	100.128,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, SANTANDER EM	ES0382041046	SAN.EMPR.1/VAR BTA 20381104 D GTIA	04/11/2038	V	100.264,68
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, SANTANDER EM	ES0337710000	SAN.EMPR.3/VAR BTA 20491016 A1 GTIA	16/10/2049	V	40.962,78
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, SANTANDER EM	ES0337710018	SAN.EMPR.3/VAR BTA 20491016 A2 GTIA	16/10/2049	V	99.953,30
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, SANTANDER EM	ES0337710026	SAN.EMPR.3/VAR BTA 20491016 A3 GTIA	16/10/2049	V	99.999,63
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, SANTANDER EM	ES0337710034	SAN.EMPR.3/VAR BTA 20491016 B GTIA	16/10/2049	V	99.970,08
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, SANTANDER EM	ES0337710042	SAN.EMPR.3/VAR BTA 20491016 C GTIA	16/10/2049	V	99.949,81
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, SANTANDER EM	ES0337710067	SAN.EMPR.3/VAR BTA 20491016 E GTIA	16/10/2049	V	100.000,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, UCI 15	ES0380957003	UCI.15/VAR BTA 20481218 A GTIA	18/12/2048	V	71.163,90
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, UCI 15	ES0380957029	UCI.15/VAR BTA 20481218 C GTIA	18/12/2048	V	99.901,64
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, UCI 17	ES0337985008	UCI.17/VAR BTA 20491217 A1 GTIA	17/12/2049	V	68.549,33
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, UCI 17	ES0337985016	UCI.17/VAR BTA 20491217 A2 GTIA	17/12/2049	V	99.999,90
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, UCI 17	ES0337985024	UCI.17/VAR BTA 20491217 B GTIA	17/12/2049	V	100.000,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, UCI 17	ES0337985032	UCI.17/VAR BTA 20491217 C GTIA	17/12/2049	V	100.000,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, UCI 17	ES0337985040	UCI.17/VAR BTA 20491217 D GTIA	17/12/2049	V	100.000,00
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 10	ES0338146006	UCI.10/VAR BTH 20360622 A GTIA	22/06/2036	V	38.295,82
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 12	ES0338147004	UCI.12/VAR BTH 20391215 A GTIA	15/12/2039	V	54.125,42
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA, BANESTO 4	ES0339774004	BANESTO.4/VAR BTH 20380315 A GTIA	15/03/2038	V	44.823,23
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA, HIPOCAT 2	ES0315226003	HIPOCAT 2/VAR BTH 20240315 A GTIA	15/03/2024	V	14.474,85
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA, HIPOTEBANSA	ES0338676002	HIPOTEBANSA IX/VAR BTH 20290818 A	18/08/2029	V	22.076,48
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA, HIPOTEBANSA	ES0338659008	HIPOTEBANSA VII/VAR BTH 20271218 A	18/12/2027	V	20.432,65
FTPYME BANCAJA 1 FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0339771034	PYME.BANCAJA.1/VAR BTA 20081020 A2	20/10/2008	V	100.220,71
FTPYME BANCAJA 2 FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0339751028	PYME.BANCAJA.2/VAR BTA 20300115 A3G	15/01/2030	V	56.065,26
FTPYME BANCAJA 3 FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0304501010	PYME.BANCAJA.3/VAR BTA 20371213 A2	13/12/2037	V	12.379,08
FTPYME BANCAJA 3 FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0304501028	PYME.BANCAJA.3/VAR BTA 20371213 A3G	13/12/2037	V	99.908,31
FTPYME BANCAJA 3 FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0304501036	PYME.BANCAJA.3/VAR BTA 20371213 B	13/12/2037	V	55.509,89
FTPYME BANCAJA 4 FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0339731020	PYME.BANCAJA.4/VAR BTA 20380724 A3G	24/07/2038	V	99.957,69
FTPYME BANCAJA 4 FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0339731038	PYME.BANCAJA.4/VAR BTA 20380724 B	24/07/2038	V	100.030,34
FTPYME BANCAJA 4 FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0339731053	PYME.BANCAJA.4/VAR BTA 20380724 D	24/07/2038	V	100.500,00
FTPYME BANCAJA 6 FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0339735021	PYME.BANCAJA.6/VAR BTA 20450927 A3G	27/09/2045	V	100.000,00
FTPYME BANESTO 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0339772040	FTPYME.BTO.1/VAR BTH 20080615 A3G	15/06/2008	V	100.155,50
FTPYME TDA 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339842009	FTPYME.TDA.3/VAR BTA 20260630 1CA	30/06/2026	V	7.111,76
FTPYME TDA 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339842017	FTPYME.TDA.3/VAR BTA 20260630 1SA	30/06/2026	V	7.137,46
FTPYME TDA 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339842041	FTPYME.TDA.3/VAR BTA 20260630 B	30/06/2026	V	5.006,65
FTPYME TDA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339752018	FTPYME.TDA.4/VAR BTA 20350726 2CA	26/07/2035	V	27.427,56
FTPYME TDA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339752026	FTPYME.TDA.4/VAR BTA 20350726 2SA	26/07/2035	V	27.551,54
FTPYME TDA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339741003	FTPYME.TDA.5/VAR BTA 20371026 1SA	26/10/2037	V	19.440,82
FTPYME TDA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339741011	FTPYME.TDA.5/VAR BTA 20371026 2CA	26/10/2037	V	99.850,20
FTPYME TDA BANCA MARCH, FONDO DE TITULIZACION	ES0339753016	PYME.TDA.MARCH/VAR BTA 20360926 2CA	26/09/2036	V	99.422,82
FTPYME TDA CAM 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0339757009	PYME.TDA.CAM.1/VAR BTA 20100526 1CA	26/05/2010	V	11.989,87
FTPYME TDA CAM 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0339758007	PYME.TDA.CAM.2/VAR BTA 20420726 1SA	26/07/2042	V	28.198,04
FTPYME TDA CAM 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0339758015	PYME.TDA.CAM.2/VAR BTA 20420726 1CA	26/07/2042	V	99.798,94
FTPYME TDA CAM 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0339758023	PYME.TDA.CAM.2/VAR BTA 20420726 2SA	26/07/2042	V	93.622,51
FTPYME TDA CAM 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0339759013	PYME.TDA.CAM.4/VAR BTA 20450928 A2	28/09/2045	V	99.095,27
FTPYME TDA CAM 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0339759047	PYME.TDA.CAM.4/VAR BTA 20450928 C	28/09/2045	V	98.809,29
FTPYME TDA SABADELL 2, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0339844005	PYME.TDA.SAB.2/VAR BTA 20230126 1CA	26/01/2023	V	47.034,26
GC FTPYME PASTOR 1, FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0316873001	GC.PYME.PAS.1/VAR BTA 20231015 AS	15/10/2023	V	18.412,08
GC FTPYME PASTOR 1, FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0316873019	GC.PYME.PAS.1/VAR BTA 20231015 AG	15/10/2023	V	18.482,11
GC FTPYME PASTOR 1, FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0316873035	GC.PYME.PAS.1/VAR BTA 20231015 C	15/10/2023	V	102.361,34
GC FTPYME PASTOR 2, FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0341168013	GC.PYME.PAS.2/VAR BTA 20371031 BG	31/10/2037	V	96.804,43
GC FTPYME PASTOR 2, FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0341168021	GC.PYME.PAS.2/VAR BTA 20371031 BS	31/10/2037	V	96.697,44
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	ES0332233016	GC.PYME.PAS.4/VAR BTA 20450715 A2	15/07/2045	V	92.848,97
GC FTPYME SABADELL 4, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0341169011	GC.PYME.SAB.4/VAR BTA 20380430 AG	30/04/2038	V	99.270,01
GC FTPYME SABADELL 5, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0332234006	GC.PYME.SAB.5/VAR BTA 20390331 A1	21/01/2008	V	99.569,94
GC FTPYME SABADELL 6, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0341099002	GC.PYME.SAB.6/VAR BTA 20390930 A1	30/09/2039	V	99.986,31
GC FTPYME SABADELL 6, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0341099010	GC.PYME.SAB.6/VAR BTA 20390930 A2	30/09/2039	V	99.927,86
GC FTPYME SABADELL 6, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0341099028	GC.PYME.SAB.6/VAR BTA 20390930 A3G	30/09/2039	V	99.900,06
GC FTPYME SABADELL 6, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0341099036	GC.PYME.SAB.6/VAR BTA 20390930 B	30/09/2039	V	99.950,00
GC FTPYME SABADELL 6, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0341099044	GC.PYME.SAB.6/VAR BTA 20390930 C	30/09/2039	V	99.850,00
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FONDO DE TITULIZACION	ES0332235003	GC.PAS.HIP.5/VAR BTA 20460630 A1	30/06/2046	V	78.476,58
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FONDO DE TITULIZACION	ES0332235011	GC.PAS.HIP.5/VAR BTA 20460630 A2	30/06/2046	V	100.000,00
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FONDO DE TITULIZACION	ES0332235029	GC.PAS.HIP.5/VAR BTA 20460630 B	30/06/2046	V	99.840,00
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FONDO DE TITULIZACION	ES0332235037	GC.PAS.HIP.5/VAR BTA 20460630 C	30/06/2046	V	99.670,00
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FONDO DE TITULIZACION	ES0332235045	GC.PAS.HIP.5/VAR BTA 20460630 D	30/06/2046	V	99.026,01
GC SABADELL 1, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARI	ES0316874017	GC SABADELL 1/VAR BTH 20380620 A2	20/06/2038	V	66.694,36
HIPOCAT 10, F.T.A.	ES0345671012	HIPOCAT 10/VAR BTA 20391024 A2 GTIA	24/10/2039	V	92.717,59
HIPOCAT 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345672002	HIPOCAT.11/VAR BTA 20500115 A1 GTIA	15/01/2050	V	63.460,26
HIPOCAT 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345672010	HIPOCAT.11/VAR BTA 20500115 A2 GTIA	15/01/2050	V	99.649,52
HIPOCAT 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345672036	HIPOCAT.11/VAR BTA 20500115 B GTIA	15/01/2050	V	100.000,00
HIPOCAT 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345672044	HIPOCAT.11/VAR BTA 20500115 C GTIA	15/01/2050	V	99.942,22
HIPOCAT 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372269003	HIPOCAT 4/VAR BTA 20331215 A GTIA	15/12/2033	V	30.189,84
HIPOCAT 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0344264009	HIPOCAT.5/VAR BTA 20331130 A GTIA	30/11/2033	V	31.676,99
HIPOCAT 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345782009	HIPOCAT.6/VAR BTA 20341215 A GTIA	15/12/2034	V	36.573,82
HIPOCAT 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345782017	HIPOCAT.6/VAR BTA 20341215 B GTIA	15/12/2034	V	82.137,51
HIPOCAT 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345783015	HIPOCAT 7/VAR BTA 20360715 A2 GTIA	15/07/2036	V	54.478,83

Nombre del emisor	ISIN	Nombre de Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
HIPOCAT 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345783031	HIPOCAT 7/VAR BTA 20360715 C GTIA	15/07/2036	V	100.140,36
HIPOCAT 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345783049	HIPOCAT 7/VAR BTA 20360715 D GTIA	15/07/2036	V	100.395,00
HIPOCAT 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345784013	HIPOCAT 8/VAR BTA 20380315 A2 GTIA	15/03/2038	V	73.618,92
HIPOCAT 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345784021	HIPOCAT 8/VAR BTA 20380315 B GTIA	15/03/2038	V	100.012,54
HIPOCAT 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345784039	HIPOCAT 8/VAR BTA 20380315 C GTIA	15/03/2038	V	100.160,00
HIPOCAT 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345721023	HIPOCAT.9/VAR BTA 20380715 A2B GTIA	15/07/2038	V	92.802,03
HIPOCAT 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345721049	HIPOCAT.9/VAR BTA 20380715 C GTIA	15/07/2038	V	100.034,86
HIPOCAT 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345721056	HIPOCAT.9/VAR BTA 20380715 D GTIA	15/07/2038	V	99.989,53
IM BANCO POPULAR FTPYME 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347847016	IM.POP.PYME/VAR BTA 20430424 AG	24/04/2043	V	99.640,00
IM CAJA LABORAL 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347565006	IM.CA.LABORAL.1/VAR BTA 20491024 A	24/10/2049	V	89.474,85
IM CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347851026	IM CAJAMAR 1/VAR BTA 20380124 C	24/01/2038	V	100.009,76
IM CAJAMAR 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347783005	IM.CAJAMAR.3/VAR BTA 20480922 A	22/09/2048	V	75.232,49
IM CAJAMAR 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0349044000	IM.CAJAMAR.4/VAR BTA 20490322 A	22/03/2049	V	84.239,92
IM CEDULAS 1 GRUPO BANCO POPULAR, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347858005	IM CEDULAS 1/4,25 BTA 20140212 GTIA	12/02/2014	4,250	98.715,81
IM CEDULAS 10, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0349045007	IM.CED.10/4,50 BTA 20220221 GTIA	21/02/2022	4,500	98.476,70
IM CEDULAS 12, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347567002	IM.CED.12/4,50 BTA 20091121 GTIA	21/11/2009	4,500	99.977,78
IM CEDULAS 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347859003	IM CEDULAS 2/4,50 BTA 20140611 A	11/06/2014	4,500	98.972,93
IM CEDULAS 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347852008	IM.CED.3/4,00 BTA 20141119 GTIA	19/11/2014	4,000	98.462,90
IM CEDULAS 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347848006	IM.CED.4/3,75 BTA 20150311 A GTIA	11/03/2015	3,750	95.997,24
IM CEDULAS 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347849004	IM CEDULAS 5/3,50 BTA 20200615 GTIA	15/06/2020	3,500	86.516,56
IM CEDULAS 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347784003	IM.CED.7/4,00 BTA 20210331 GTIA	31/03/2021	4,000	93.768,24
IM CEDULAS 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347785000	IM.CED.9/4,25 BTA 20160609 GTIA	09/06/2016	4,250	97.830,58
IM FTPYME SABADELL 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347853006	IM.PYME.SAB.3/VAR BTA 20371021 1SA	21/10/2037	V	29.798,09
IM FTPYME SABADELL 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347853014	IM.PYME.SAB.3/VAR BTA 20371021 1CA	21/10/2037	V	99.897,69
IM GOYA HIPOTECARIO I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0349046005	IM.GOYA.HIP.I/VAR BTA 20400715 A1	15/07/2040	V	50.000,00
IM GOYA HIPOTECARIO I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0349046013	IM.GOYA.HIP.I/VAR BTA 20400715 A2	15/07/2040	V	50.000,00
IM GOYA HIPOTECARIO I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0349046021	IM.GOYA.HIP.I/VAR BTA 20400715 B	15/07/2040	V	50.000,00
IM GOYA HIPOTECARIO I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0349046039	IM.GOYA.HIP.I/VAR BTA 20400715 C	15/07/2040	V	50.000,00
IM GOYA HIPOTECARIO I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0349046047	IM.GOYA.HIP.I/VAR BTA 20400715 D	15/07/2040	V	50.000,00
IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347843007	IM.POP.EMP.1/VAR BTA 20330321 A1	21/03/2033	V	7.196,55
IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347843015	IM.POP.EMP.1/VAR BTA 20330321 A2	21/03/2033	V	98.713,26
IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347843031	IM.POP.EMP.1/VAR BTA 20330321 C	21/03/2033	V	98.122,28
IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347843049	IM.POP.EMP.1/VAR BTA 20330321 D	21/03/2033	V	99.735,05
IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0349047003	IM.POP.EMP.2/VAR BTA 20441124 A	24/11/2044	V	100.000,00
IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0349047011	IM.POP.EMP.2/VAR BTA 20441124 B	24/11/2044	V	100.000,00
IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0349047029	IM.POP.EMP.2/VAR BTA 20441124 C	24/11/2044	V	100.000,00
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347844013	IM.POP.PYME.I/VAR BTA 20390921 A2	21/09/2039	V	14.129,08
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347844021	IM.POP.PYME.I/VAR BTA 20390921 A3	21/09/2039	V	100.032,06
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347844039	IM.POP.PYME.I/VAR BTA 20390921 A4	21/09/2039	V	100.023,65
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347844070	IM.POP.PYME.I/VAR BTA 20390921 C	21/09/2039	V	99.755,94
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347786008	IM.POP.PYME.II/VAR BTA 20410124 A1	24/01/2041	V	92.224,64
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347786032	IM.POP.PYME.II/VAR BTA 20410124 B	24/01/2041	V	99.954,31
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347786040	IM.POP.PYME.II/VAR BTA 20410124 C	24/01/2041	V	99.953,73
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347786065	IM.POP.PYME.II/VAR BTA 20410124 E	24/01/2041	V	100.000,00
IM PASTOR 2, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0347861009	IM.PASTOR 2/VAR BTH 20410922 A GTIA	22/09/2041	V	50.749,72
IM PASTOR 3, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0347862007	IM.PAS.3/VAR BTH 20430322 A GTIA	22/03/2043	V	56.205,81
IM PASTOR 3, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0347862023	IM.PAS.3/VAR BTH 20430322 C GTIA	22/03/2043	V	99.620,00
IM PASTOR 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347854004	IM.PAS.4/VAR BTA 20440322 A GTIA	22/03/2044	V	75.484,63
IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347787006	IM.PREST.F.CED./VAR BTA 20220124 A	24/01/2022	V	100.000,00
IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347787014	IM.PREST.F.CED./VAR BTA 20220124 B	24/01/2022	V	100.000,00
IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347787022	IM.PREST.F.CED./VAR BTA 20220124 C	24/01/2022	V	100.000,00
IM TERRASSA MBS 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347855001	IM.TERR.MBS.1/VAR BTA 20490724 A	24/07/2049	V	78.571,84
IM TERRASSA MBS 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347855027	IM.TERR.MBS.1/VAR BTA 20490724 C	24/07/2049	V	100.000,00
INTERMONEY MASTER CEDULAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0362859003	INTER.MAST.CED/3,50 BTA 20151202 M1	02/12/2015	3,500	93.375,84
MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359091008	MADRID.RMBS.I/VAR BTA 20490622 A1	22/06/2049	V	56.835,75
MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359091016	MADRID.RMBS.I/VAR BTA 20490622 A2	22/06/2049	V	99.737,49
MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359091024	MADRID.RMBS.I/VAR BTA 20490622 B	22/06/2049	V	100.054,53
MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359091032	MADRID.RMBS.I/VAR BTA 20490622 C	22/06/2049	V	99.920,70
MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359091040	MADRID.RMBS.I/VAR BTA 20490622 D	22/06/2049	V	97.986,10
MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359092006	MADRID.RMBS.II/VAR BTA 20490822 A1	22/08/2049	V	59.623,83
MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359092014	MADRID.RMBS.II/VAR BTA 20490822 A2	22/08/2049	V	99.385,53
MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359092030	MADRID.RMBS.II/VAR BTA 20490822 E	22/08/2049	V	100.055,77
MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359092048	MADRID.RMBS.II/VAR BTA 20490822 C	22/08/2049	V	100.153,91
MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359092055	MADRID.RMBS.II/VAR BTA 20490822 D	22/08/2049	V	100.046,02
MADRID RMBS III, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359093012	MADRID.RMBS.III/VAR BTA 20500222 A2	22/02/2050	V	100.000,00
MADRID RMBS III, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359093020	MADRID.RMBS.III/VAR BTA 20500222 A3	22/02/2050	V	100.000,00
MBS BANCAJA 1 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361794003	MBS.BANCAJA.1/VAR BTA 20351117 A	17/11/2035	V	38.045,38
MBS BANCAJA 1 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361794029	MBS.BANCAJA.1/VAR BTA 20351117 C	17/11/2035	V	85.099,25
MBS BANCAJA 1 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361794037	MBS.BANCAJA.1/VAR BTA 20351117 D	17/11/2035	V	85.147,40
MBS BANCAJA 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361795000	MBS.BANCAJA.2/VAR BTA 20380225 A	25/02/2038	V	55.944,02
MBS BANCAJA 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361795018	MBS.BANCAJA.2/VAR BTA 20380225 B	25/02/2038	V	99.955,00
MBS BANCAJA 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361796016	MBS.BANCAJA.3/VAR BTA 20431226 A2	26/12/2043	V	80.047,12
MBS BANCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361797006	MBS.BANCAJA.4/VAR BTA 20500723 A1	23/07/2050	V	51.429,73
MBS BANCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361797014	MBS.BANCAJA.4/VAR BTA 20500723 A2	23/07/2050	V	99.919,34
MBS BANCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361797030	MBS.BANCAJA.4/VAR BTA 20500723 B	23/07/2050	V	100.000,00
MBS BANCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361797055	MBS.BANCAJA.4/VAR BTA 20500723 D	23/07/2050	V	100.000,00
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDEZ	ES0314969009	CA.SAN.FERN/VAR BO 20100818	18/08/2010	V	99.733,01
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDEZ	ES0314969017	CA.SAN.FERN/VAR BO 20090302	02/03/2009	V	99.986,60
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES0364872012)	ES0364872012	UNICAJA/VAR BO 20090323	23/03/2009	V	99.799,11
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES0364872020)	ES0364872020	UNICAJA/VAR BO 20100512	12/05/2010	V	99.710,36
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES0364872038)	ES0364872038	UNICAJA/VAR BO 20110726	26/07/2011	V	49.770,50
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES0364872053)	ES0364872053	UNICAJA/VAR BO 20080929	29/09/2008	V	49.871,10
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES0364872061)	ES0364872061	UNICAJA/VAR BO 20090618	18/06/2009	V	49.990,98
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES0364872079)	ES0364872079	UNICAJA/VAR BO 20100618	18/06/2010	V	50.000,00
PROGRAMA CEDULAS TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0371622004	PROG.CED.TDA/VAR BTA 20160408 A1	08/04/2016	V	99.732,16
PROGRAMA CEDULAS TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0371622012	PROG.CED.TDA/4,13 BTA 20210410 A4	10/04/2021	4,125	95.562,75
PROGRAMA CEDULAS TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0371622020	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20310410 A6	10/04/2031	4,250	93.580,79
PROGRAMA CEDULAS TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0371622038	PROG.CED.TDA/4,00 BTA 20181023 A3	23/10/2018	4,000	92.436,53
PROGRAMA CEDULAS TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0371622046	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20270328 A5	28/03/2027	4,250	94.945,78
PYME BANCAJA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372259020	PYME.BANCAJA.5/VAR BTA 20390214 A3	14/02/2039	V	99.554,93
PYME BANCAJA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372259038	PYME.BANCAJA.5/VAR BTA 20390214 B	14/02/2039	V	99.932,36
PYME VALENCIA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372241002	PYME.VALENCIA1/VAR BTA 20400323 A1	23/03/2040	V	46.058,04

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
PYME VALENCIA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372241010	PYME.VALENCIA1/VAR BTA 20400323 A2	23/03/2040	V	99.998,71
PYME VALENCIA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372241028	PYME.VALENCIA1/VAR BTA 20400323 E	23/03/2040	V	100.000,00
PYME VALENCIA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372241036	PYME.VALENCIA1/VAR BTA 20400323 C	23/03/2040	V	100.000,00
PYME VALENCIA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372241044	PYME.VALENCIA1/VAR BTA 20400323 D	23/03/2040	V	100.000,00
PYME VALENCIA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372241051	PYME.VALENCIA1/VAR BTA 20400323 E	23/03/2040	V	100.000,00
PYMES BANESTO 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372260002	PYMES.BTO.2/VAR BTA 20311231 A1	31/12/2031	V	99.320,49
PYMES BANESTO 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372260036	PYMES.BTO.2/VAR BTA 20311231 C	31/12/2031	V	99.991,80
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA	ES0374273003	RURAL.HIP.GBL.I/VAR BTA 20390118 A	18/01/2039	V	71.993,84
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA	ES0374273029	RURAL.HIP.GBL.I/VAR BTA 20390118 C	18/01/2039	V	100.091,24
RURAL HIPOTECARIO III FONDO DE TITULIZACION HIPO	ES0358282004	RURAL.HIP.III/VAR BTH 20320313 A	13/03/2032	V	35.907,52
RURAL HIPOTECARIO IV FONDO DE TITULIZACION HIPO	ES0358283002	RURAL.HIP.IV/VAR BTH 20330213 A	13/02/2033	V	38.282,73
RURAL HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0374274001	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 A1	17/02/2050	V	43.293,44
RURAL HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0374274019	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 A2	17/02/2050	V	99.838,14
RURAL HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0374274027	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 A3	17/02/2050	V	100.000,00
RURAL HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0374274035	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 B	17/02/2050	V	100.000,00
RURAL HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0374274043	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 C	17/02/2050	V	100.000,00
RURAL HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0374274050	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 D	17/02/2050	V	100.000,00
RURAL HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0374274068	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 E	17/02/2050	V	50.000,00
RURAL HIPOTECARIO V FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0358284000	RURAL.HIP.V/VAR BTH 20350315 A1	15/03/2035	V	42.690,40
RURAL HIPOTECARIO VI, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0374306001	RURAL.HIP.VI/VAR BTA 20361017 A	17/10/2036	V	56.619,62
RURAL HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0366366005	RURAL.HIP.VII/VAR BTA 20380315 A1	15/03/2038	V	61.938,00
RURAL HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0366366021	RURAL.HIP.VII/VAR BTA 20380315 B	15/03/2038	V	99.673,38
RURAL HIPOTECARIO VIII, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0366367011	RURAL.HIP.VIII/VAR BTA 20440119 A2A	19/01/2044	V	88.347,41
RURAL HIPOTECARIO VIII, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0366367045	RURAL.HIP.VIII/VAR BTA 20440119 C	19/01/2044	V	100.030,59
RURALPYME 1 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0374351015	RURALPYME.1/VAR BTA 20351221 A2G	21/12/2035	V	99.982,87
RURALPYME 2 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0374352005	RURALPYME.2/VAR BTA 20300425 A1	25/04/2030	V	75.724,76
RURALPYME 2 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0374352013	RURALPYME.2/VAR BTA 20300425 A2G	25/04/2030	V	99.960,00
RURALPYME 2 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0374352039	RURALPYME.2/VAR BTA 20300425 C	25/04/2030	V	100.026,20
RURALPYME 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0366368001	RURALPYME.3/VAR BTA 20410424 A GTIA	24/04/2041	V	100.000,00
RURALPYME 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0366368019	RURALPYME.3/VAR BTA 20410424 B GTIA	24/04/2041	V	100.000,00
RURALPYME 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0366368027	RURALPYME.3/VAR BTA 20410424 C GTIA	24/04/2041	V	100.000,00
RURALPYME 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0366368035	RURALPYME.3/VAR BTA 20410424 D GTIA	24/04/2041	V	100.000,00
RURALPYME 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0366368043	RURALPYME.3/VAR BTA 20410424 E GTIA	24/04/2041	V	50.000,00
SANTANDER CONSUMER FINANCE SPAIN 02-1, FTA	ES0309363002	SAN.CO.FIN.02-1/VAR BTA 20121223 A	23/12/2012	V	10.967,77
SANTANDER EMISORA 150, S.A. UNIPERSONAL	ES0307779901	SAN.EMISORA.150/VAR BO 20121004	04/10/2012	V	5.118,35
SANTANDER HIPOTECARIO I, FONDO DE TITULIZACION	ES0309364018	SAN.HIP.I/VAR BTA 20420715 B GTIA	15/07/2042	V	101.250,00
TDA 10, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0378026019	TDA 10/VAR BTH 20120322 A2 GTIA	22/03/2012	V	24.174,73
TDA 10, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0378026027	TDA 10/CUPCER BTH 20120622 B GTIA	22/06/2012	C	100.681,16
TDA 11, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0378014023	TDA 11/VAR BTH 20120726 A3 GTIA	26/07/2012	V	30.424,62
TDA 12, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0377976024	TDA 12/VAR BTH 20300426 A3 GTIA	26/04/2030	V	35.230,38
TDA 12, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0377976032	TDA 12/VAR BTH 20300426 B GTIA	26/04/2030	V	100.206,49
TDA 13 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377977006	TDA 13-MIXTO/VAR BTH 20151026 A1	26/10/2015	V	28.349,13
TDA 13 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377977014	TDA 13-MIXTO/VAR BTH 20151026 B1	26/10/2015	V	101.190,16
TDA 14 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377978020	TDA 14-MIXTO/VAR BTH 20310126 A3	26/01/2031	V	45.072,57
TDA 14 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377978046	TDA 14-MIXTO/VAR BTH 20310126 AN	26/01/2031	V	28.187,64
TDA 15 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377979002	TDA 15-MIX/VAR BTA 20320628 A1 GTIA	28/06/2032	V	43.504,87
TDA 15 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377979028	TDA 15-MIX/VAR BTA 20420627 A2 GTIA	27/06/2042	V	39.305,12
TDA 16 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377973005	TDA 16-MIX/VAR BTA 20350322 A1 GTIA	22/03/2035	V	33.727,38
TDA 16 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377973021	TDA 16-MIX/VAR BTA 20350322 A2 GTIA	22/03/2035	V	36.232,34
TDA 19 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377964004	TDA 19-MIXTO/VAR BTA 20360322 A	22/03/2036	V	47.675,17
TDA 20 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377981008	TDA 20-MIX/VAR BTA 20360426 A1 GTIA	26/04/2036	V	58.267,46
TDA 20 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377981016	TDA 20-MIX/VAR BTA 20360426 B1 GTIA	26/04/2036	V	101.421,61
TDA 20 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377981024	TDA 20-MIX/VAR BTA 20360426 A2 GTIA	26/04/2036	V	51.252,54
TDA 22 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377983004	TDA 22-MIXTO/VAR BTA 20460628 A1A	28/06/2046	V	35.439,62
TDA 22 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377983012	TDA 22-MIXTO/VAR BTA 20460628 A1B	28/06/2046	V	100.350,00
TDA 22 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377983053	TDA 22-MIXTO/VAR BTA 20460628 A2A	28/06/2046	V	36.755,26
TDA 22 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377983061	TDA 22-MIXTO/VAR BTA 20460628 A2B	28/06/2046	V	100.400,00
TDA 23, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377984002	TDA 23/VAR BTA 20460922 A GTIA	22/09/2046	V	60.442,92
TDA 24, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377952009	TDA 24/VAR BTA 20400622 A1 GTIA	22/06/2040	V	63.367,16
TDA 24, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377952033	TDA 24/VAR BTA 20400622 C GTIA	22/06/2040	V	98.184,02
TDA 25, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377929007	TDA 25/VAR BTA 20410322 A GTIA	22/03/2041	V	77.792,91
TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377953007	TDA 26-MIXTO/VAR BTA 20490128 1A1	28/01/2008	V	14.177,25
TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377953015	TDA 26-MIXTO/VAR BTA 20490128 1A2	28/01/2009	V	100.020,00
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954005	TDA 27/VAR BTA 20501228 A1 GTIA	28/12/2050	V	62.595,21
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954013	TDA 27/VAR BTA 20501228 A2 GTIA	28/12/2050	V	99.963,47
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954021	TDA 27/VAR BTA 20501228 A3 GTIA	28/12/2050	V	100.000,00
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954039	TDA 27/VAR BTA 20501228 B GTIA	28/12/2050	V	100.000,00
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954047	TDA 27/VAR BTA 20501228 C GTIA	28/12/2050	V	100.022,06
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954054	TDA 27/VAR BTA 20501228 D GTIA	28/12/2050	V	100.015,04
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954062	TDA 27/VAR BTA 20501228 E GTIA	28/12/2050	V	100.420,41
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954070	TDA 27/VAR BTA 20501228 F GTIA	28/12/2050	V	99.934,73
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954088	TDA 27/VAR BTA 20091228 IO GTIA	28/12/2009	V	16.000,00
TDA 28, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377930005	TDA 28/VAR BTA 20501028 A GTIA	28/10/2050	V	98.341,59
TDA 28, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377930013	TDA 28/VAR BTA 20501028 B GTIA	28/10/2050	V	100.000,00
TDA 28, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377930021	TDA 28/VAR BTA 20501028 C GTIA	28/10/2050	V	100.000,00
TDA 28, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377930039	TDA 28/VAR BTA 20501028 D GTIA	28/10/2050	V	100.000,00
TDA 28, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377930047	TDA 28/VAR BTA 20501028 E GTIA	28/10/2050	V	100.000,00
TDA 28, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377930054	TDA 28/VAR BTA 20501028 F GTIA	28/10/2050	V	49.994,68
TDA 28, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377930062	TDA 28/VAR BTA 20501028 NASIO GTIA	28/07/2010	V	16.000,00
TDA 29, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377931003	TDA 29/VAR BTA 20500228 A1 GTIA	28/02/2050	V	93.603,21
TDA 29, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377931011	TDA 29/VAR BTA 20500228 A2 GTIA	28/02/2050	V	100.000,00
TDA 29, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377931029	TDA 29/VAR BTA 20500228 B GTIA	28/02/2050	V	100.000,00
TDA 29, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377931037	TDA 29/VAR BTA 20500228 C GTIA	28/02/2050	V	100.000,00
TDA 7, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0308184029	TDA.7/VAR BTH 20281117 A3 GTIA	17/11/2028	V	23.965,44
TDA 7, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0308184037	TDA.7/VAR BTH 20281117 A1 GTIA	17/11/2028	V	99.430,44

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
TDA CAJAMAR 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377965019	TDA.CAJAMAR.2/VAR BTA 20410626 A2	26/06/2041	V	69.551,93
TDA CAJAMAR 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377965035	TDA.CAJAMAR.2/VAR BTA 20410626 B	26/06/2041	V	99.988,47
TDA CAM 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338448006	TDA.CAM.1/VAR BTA 20320922 A GTIA	22/09/2032	V	44.343,75
TDA CAM 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338449004	TDA.CAM.2, FTA/VAR BTA 20321026 A	26/10/2032	V	45.967,88
TDA CAM 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377990009	TDA.CAM.3/VAR BTA 20330426 A GTIA	26/04/2033	V	50.306,63
TDA CAM 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377991007	TDA.CAM.4/VAR BTA 20390626 A GTIA	26/06/2039	V	62.509,34
TDA CAM 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377992005	TDA.CAM.5/VAR BTA 20431026 A GTIA	26/10/2043	V	75.242,25
TDA CAM 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377992013	TDA.CAM.5/VAR BTA 20431026 B GTIA	26/10/2043	V	100.278,61
TDA CAM 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377993003	TDA.CAM.6/VAR BTA 20120728 A1 GTIA	28/07/2012	V	75.398,46
TDA CAM 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377993011	TDA.CAM.6/VAR BTA 20160428 A2 GTIA	28/04/2016	V	99.771,97
TDA CAM 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377993029	TDA.CAM.6/VAR BTA 20440428 A3 GTIA	28/04/2044	V	80.612,87
TDA CAM 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377994019	TDA.CAM.7/VAR BTA 20490226 A2 GTIA	26/02/2049	V	84.933,20
TDA CAM 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377994035	TDA.CAM.7/VAR BTA 20490226 B GTIA	26/02/2049	V	100.120,72
TDA CAM 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377966009	TDA.CAM.8/VAR BTA 20490226 A GTIA	26/02/2049	V	92.456,37
TDA CAM 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377966017	TDA.CAM.8/VAR BTA 20490226 B GTIA	26/02/2049	V	99.962,92
TDA CAM 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377966025	TDA.CAM.8/VAR BTA 20490226 C GTIA	26/02/2049	V	99.972,71
TDA CAM 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377955002	TDA.CAM.9/VAR BTA 20500428 A1 GTIA	28/04/2050	V	95.489,61
TDA CAM 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377955010	TDA.CAM.9/VAR BTA 20500428 A2 GTIA	28/04/2050	V	97.942,89
TDA IBERCAJA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338450002	TDA.IBERCAJA.1/VAR BTA 20350726 A	26/07/2035	V	53.761,88
TDA IBERCAJA 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338451000	TDA.IBERCAJA.2/VAR BTA 20421026 A	26/10/2042	V	75.162,33
TDA IBERCAJA 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338452008	TDA.IBERCAJA.3/VAR BTA 20431228 A	28/12/2043	V	79.337,88
TDA IBERCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338453014	TDA.IBERCAJA.4/VAR BTA 20440826 A2	26/08/2044	V	82.831,42
TDA IBERCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338453048	TDA.IBERCAJA.4/VAR BTA 20440826 C	26/08/2044	V	100.045,00
TDA IBERCAJA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377967007	TDA.IBERCAJA.5/VAR BTA 20491126 A1	26/11/2049	V	92.330,09
TDA IBERCAJA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377967015	TDA.IBERCAJA.5/VAR BTA 20491126 A2	26/11/2049	V	94.381,24
TDA IBERCAJA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377967023	TDA.IBERCAJA.5/VAR BTA 20491126 B	26/11/2049	V	100.000,00
TDA IBERCAJA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377967031	TDA.IBERCAJA.5/VAR BTA 20491126 C	26/11/2049	V	99.987,29
TDA IBERCAJA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377967049	TDA.IBERCAJA.5/VAR BTA 20491126 D	26/11/2049	V	100.000,00
TDA PASTOR 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377980000	TDA.PASTOR.1/VAR BTA 20381228 A1	28/12/2038	V	34.559,89
TDA PASTOR CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0338454004	PASTOR.CONS.1/VAR BTA 20210128 A	28/01/2021	V	99.873,53
TDA PASTOR CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0338454012	PASTOR.CONS.1/VAR BTA 20210128 B	28/01/2021	V	99.988,35
TDA PASTOR CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0338454020	PASTOR.CONS.1/VAR BTA 20210128 C	28/01/2021	V	99.910,81
VALENCIA HIPOTECARIO 2, FONDO DE TITULIZACION HI	ES0382745000	VALENCIA.HIP.2/VAR BTH 20430124 A	24/01/2043	V	73.954,19
VALENCIA HIPOTECARIO 2, FONDO DE TITULIZACION HI	ES0382745018	VALENCIA.HIP.2/VAR BTH 20430124 B	24/01/2043	V	100.115,00
VALENCIA HIPOTECARIO 2, FONDO DE TITULIZACION HI	ES0382745026	VALENCIA.HIP.2/VAR BTH 20430124 C	24/01/2043	V	99.216,94
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FONDO DE TITULIZACION DI	ES0382746016	VALENCIA.HIP.3/VAR BTA 20440922 A2	22/09/2044	V	94.449,66
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FONDO DE TITULIZACION DI	ES0382746032	VALENCIA.HIP.3/VAR BTA 20440922 C	22/09/2044	V	100.102,18
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FONDO DE TITULIZACION DI	ES0382746040	VALENCIA.HIP.3/VAR BTA 20440922 D	22/09/2044	V	100.000,00

**RENTA FIJA****CEDULAS**

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211006	BBVA/5,50 CEDHIP 20091015 GTIA	15/10/2009	5,500	101.984,43
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211014	BBVA/5,75 CEDHIP 20100927 GTIA	27/09/2010	5,750	103.622,15
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211030	BBVA/4,25 CEDHIP 20130129 GTIA	29/01/2013	4,250	98.554,54
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211048	BBVA/3,50 CEDHIP 20110315 GTIA	15/03/2011	3,500	96.953,47
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211055	BBVA/4,25 CEDHIP 20140715 GTIA	15/07/2014	4,250	97.377,55
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211063	BBVA/3,00 CEDHIP 20091203 GTIA	03/12/2009	3,000	97.038,43
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211071	BBVA/4,00 CEDHIP 20250225 GTIA	25/02/2025	4,000	90.742,51
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211089	BBVA/3,50 CEDHIP 20150225 GTIA	25/02/2015	3,500	94.711,90
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211097	BBVA/2,75 CEDHIP 20100607 GTIA	07/06/2010	2,750	95.639,76
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211105	BBVA/3,50 CEDHIP 20201007 GTIA	07/10/2020	3,500	88.334,33
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211113	BBVA/3,25 CEDHIP 20160124 GTIA	24/01/2016	3,250	91.040,25
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211121	BBVA/3,50 CEDHIP 20210124 GTIA	24/01/2021	3,500	88.508,18
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211139	BBVA/3,875 CEDHIP 20120531 GTIA	31/05/2012	3,875	98.073,95
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211154	BBVA/3,75 CEDHIP 20131004 GTIA	04/10/2013	3,750	95.409,56
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211162	BBVA/3,75 CEDTER 20111123 GTIA	23/11/2011	3,750	97.293,44
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211170	BBVA/4,25 CEDHIP 20170118 GTIA	18/01/2017	4,250	98.603,64
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211196	BBVA/4,35 CEDHIP 20170301 GTIA	01/03/2017	4,350	99.920,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211204	BBVA/4,50 CEDTER 20140530 GTIA	30/05/2014	4,500	94.471,33
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211261	BBVA/4,625 CEDTER 20120802 GTIA	02/08/2012	4,625	99.905,54
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0424207001	ARGENTARIA/4,375 CEDHIP 20090405	05/04/2009	4,375	100.400,54
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0400230001	BCO.CTO.LOCAL/3,75 CEDTER 20100407	07/04/2010	3,750	98.398,28
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0400230019	BCO.CTO.LOCAL/3,75 CEDTER 20090630	30/06/2009	3,750	98.864,79
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0400230050	BCO.CTO.LOCAL/2,75 CEDTER 20080317	17/03/2008	2,750	98.858,53
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0400230068	BCO.CTO.LOCAL/3,75 CEDTER 20111020	20/10/2011	3,750	97.142,14
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860000	SAB/4,50 CEDHIP 20130429 GTIA	29/04/2013	4,500	99.636,86
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860018	SAB/3,75 CEDHIP 20110126 GTIA	26/01/2011	3,750	98.258,15
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860026	SAB/3,25 CEDHIP 20150615 GTIA	15/06/2015	3,250	91.014,19
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860034	SAB/3,50 CEDHIP 20160119 GTIA	19/01/2016	3,500	92.466,46
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860067	SAB/4,25 CEDHIP 20170124 GTIA	24/01/2017	4,250	97.766,19
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440035	BTO/4,00 CEDHIP 20100512 GTIA	12/05/2010	4,000	99.055,12
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440043	BTO/3,75 CEDHIP 20110223 GTIA	23/02/2011	3,750	97.361,25
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440050	BTO/4,25 CEDHIP 20140916 GTIA	16/09/2014	4,250	97.598,46
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440068	BTO/3,50 CEDHIP 20150127 GTIA	27/01/2015	3,500	94.151,72
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440076	BTO/2,75 CEDHIP 20120907 GTIA	07/09/2012	2,750	92.585,75
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440084	BTO/3,50 CEDHIP 20160118 GTIA	18/01/2016	3,500	92.199,29
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440092	BTO/4,25 CEDHIP 20130712 GTIA	12/07/2013	4,250	97.780,28
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440100	BTO/4,25 CEDHIP 20140221 GTIA	21/02/2014	4,250	99.574,08
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770001	PAS/3,75 CEDHIP 20150304 GTIA	04/03/2015	3,750	94.358,58
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770019	PAS/3,875 CEDHIP 20130920 GTIA	20/09/2013	3,875	96.849,83
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790009	POP/3,00 CEDHIP 20121018 GTIA	18/10/2012	3,000	94.058,56
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790017	POP/4,00 CEDHIP 20161018 GTIA	18/10/2016	4,000	94.944,46
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790025	POP/4,445 CEDHIP 20091116 GTIA	16/11/2009	4,445	100.000,00
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900020	SAN/4,00 CEDTER 20130708 GTIA	08/07/2013	4,000	97.060,06
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900038	SAN/4,00 CEDHIP 20100910 GTIA	10/09/2010	4,000	98.696,66
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900046	SAN/3,75 CEDHIP 20081219 GTIA	19/12/2008	3,750	99.209,23
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900061	SAN/4,50 CEDHIP 20160729 GTIA	29/07/2016	4,500	98.537,88
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900079	SAN/3,25 CEDHIP 20120207 GTIA	07/02/2012	3,250	95.241,87
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900087	SAN/4,00 CEDHIP 20200407 GTIA	07/04/2020	4,000	91.933,63
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900095	SAN/2,50 CEDHIP 20110128 GTIA	28/01/2011	2,500	94.030,71
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900103	SAN/3,125 CEDHIP 20150928 GTIA	28/09/2015	3,125	89.659,19
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900111	SAN/3,50 CEDHIP 20140206 GTIA	06/02/2014	3,500	95.237,45
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900129	SAN/3,875 CEDHIP 20260206 GTIA	06/02/2026	3,875	86.188,85
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900137	SAN/3,75 CEDHIP 20110908 GTIA	08/09/2011	3,750	97.339,07
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900145	SAN/4,125 CEDHIP 20170109 GTIA	09/01/2017	4,125	98.048,17
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900152	SAN/4,25 CEDHIP 20130506 GTIA	06/05/2013	4,250	98.220,93
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900160	SAN/4,625 CEDHIP 20270504 GTIA	04/05/2027	4,625	96.654,92
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900178	SAN/4,50 CEDHIP 20121114 GTIA	14/11/2012	4,500	99.705,67
CAIXA DE AHORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA	ES0414958092	CAIXANOVA/VAR CEDHIP 20081006 GTIA	06/10/2008	V	600,02
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0414840274	CA.CATALUNYA/3,50 CEDHIP 20160307	07/03/2016	3,500	92.199,80
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0414840308	CA.CATALUNYA/4,875 CEDHIP 20170629	29/06/2017	4,875	100.096,96
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0414843138	CAIXAGALICIA/VAR CEDTER 20110713	13/07/2011	V	99.822,39
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0414843146	CAIXAGALICIA/4,375 CEDHIP 20190123	23/01/2019	4,375	98.807,85
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854010	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20091029 GTIA	29/10/2009	V	997,01
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854028	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20091229 GTIA	29/12/2009	V	998,22
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854036	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20120629 GTIA	29/06/2012	V	994,22
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854044	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20120929 GTIA	29/09/2012	V	997,88
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950552	CA.MADRID/5,50 CEDHIP 20100115 GTIA	15/01/2010	5,500	102.547,36
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950560	CA.MADRID/5,75 CEDHIP 20160629 GTIA	29/06/2016	5,750	107.215,63
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950586	CA.MADRID/5,25 CEDHIP 20120301 GTIA	01/03/2012	5,250	103.204,82
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950594	CA.MADRID/5,00 CEDHIP 20141030 GTIA	30/10/2014	5,000	103.745,35
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950602	CA.MADRID/3,75 CEDHIP 20091022 GTIA	22/10/2009	3,750	98.890,79
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950610	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20110325 GTIA	25/03/2011	3,500	96.929,98
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950628	CA.MADRID/4,00 CEDHIP 20250203 GTIA	03/02/2025	4,000	90.420,96
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950636	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20151214 GTIA	14/12/2015	3,500	92.763,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950644	CA.MADRID/4,125 CEDHIP 20360324	24/03/2036	4,125	44.986,79
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950651	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20180525 GTIA	25/05/2018	4,250	48.281,96
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950669	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20160705 GTIA	05/07/2016	4,250	48.078,89
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950677	CA.MADRID/4,25 CEDTER 20140221 GTIA	21/02/2014	4,250	49.154,59
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950685	CA.MADRID/4,50 CEDHIP 20220426 GTIA	26/04/2022	4,500	48.570,20
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950693	CA.MADRID/5,00 CEDHIP 20190628 GTIA	28/06/2019	5,000	49.824,13
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970139	LACAIXA/5,25 CEDHIP 20110405 GTIA	05/04/2011	5,250	102.407,97
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970162	LACAIXA/4,50 CEDHIP 20121121 GTIA	21/11/2012	4,500	100.451,25
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970170	LACAIXA/3,50 CEDHIP 20100301 GTIA	01/03/2010	3,500	97.961,50
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970188	LACAIXA/4,25 CEDHIP 20131031 GTIA	31/10/2013	4,250	97.826,17
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970196	LACAIXA/4,75 CEDHIP 20181031 GTIA	31/10/2018	4,750	100.763,73
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970204	LACAIXA/3,875 CEDHIP 20250217 GTIA	17/02/2025	3,875	87.480,18
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970212	LACAIXA/3,25 CEDHIP 20151005 GTIA	05/10/2015	3,250	90.383,56
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970238	LACAIXA/5,25 CEDHIP 20140630 GTIA	30/06/2014	5,250	46.567,34
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970246	LACAIXA/3,625 CEDHIP 20210118 GTIA	18/01/2021	3,625	43.963,52
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970253	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160630 GTIA	30/06/2016	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970261	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160616 GTIA	16/06/2016	V	99.710,17
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970295	LACAIXA/4,25 CEDHIP 20170126 GTIA	26/01/2017	4,250	48.480,10
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970303	LACAIXA/4,50 CEDHIP 20220126 GTIA	26/01/2022	4,500	49.201,31
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970311	LACAIXA/3,75 CEDTER 20110913 GTIA	13/09/2011	3,750	48.935,23
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970337	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160930 GTIA	30/09/2016	V	999,94
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970352	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170330 GTIA	30/03/2017	V	999,97
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970394	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170930 GTIA	30/09/2017	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970402	LACAIXA/4,625 CEDHIP 20190604 GTIA	04/06/2019	4,625	49.525,48
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0414981219	CAJACANARIAS/VAR CEDHIP 20090618	18/06/2009	V	399,01
DEXIA SABADELL, S.A.	ES0426396059	DEXIA.SAB/VAR CEDTER 20100516 GTIA	16/05/2010	V	99.361,44
DEXIA SABADELL, S.A.	ES0426396067	DEXIA.SAB/VAR CEDTER 20100612 GTIA	12/06/2010	V	99.657,25
DEXIA SABADELL, S.A.	ES0426396075	DEXIA.SAB/VAR CEDTER 20110222 GTIA	22/02/2011	V	99.920,73
DEXIA SABADELL, S.A.	ES0426396083	DEXIA.SAB/VAR CEDTER 20110227 GTIA	27/02/2011	V	99.889,71
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0413495005	SAN.CONS.FIN/3,875 CEDHIP 20160323	23/03/2016	3,875	95.284,47

**RENTA FIJA****PAGARÉS**

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845564	ABE/PAG 20080403	03/04/2008	C	97.648,26
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845606	ABE/PAG 20080603	03/06/2008	C	97.645,91
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845614	ABE/PAG 20080604	04/06/2008	C	97.637,07
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845622	ABE/PAG 20081203	03/12/2008	C	95.438,91
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845630	ABE/PAG 20081209	09/12/2008	C	95.410,74
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845648	ABE/PAG 20080327	27/03/2008	C	98.805,27
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845655	ABE/PAG 20080117	17/01/2008	C	99.738,25
AYT AUTOMOCION I MMC ESPAÑA, FONDO DE TITULIZA	ES0512354137	AUTO.I.MMC/PAG 20080208	08/02/2008	C	98.838,76
AYT AUTOMOCION II COFIBER E.F.C., FONDO DE TITULI	ES0512211089	AUTO.II.COF/PAG 20080104	04/01/2008	C	99.197,02
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040HX3	BCA.MARCH/PAG 20080104	04/01/2008	C	961,27
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040IH4	BCA.MARCH/PAG 20080111	11/01/2008	C	988,03
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040IL6	BCA.MARCH/PAG 20080116	16/01/2008	C	967,70
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040IM4	BCA.MARCH/PAG 20080117	17/01/2008	C	972,24
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040IX1	BCA.MARCH/PAG 20080201	01/02/2008	C	973,74
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040JD1	BCA.MARCH/PAG 20080207	07/02/2008	C	988,78
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040JS9	BCA.MARCH/PAG 20080225	25/02/2008	C	962,57
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040JZ4	BCA.MARCH/PAG 20080305	05/03/2008	C	976,80
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040KG2	BCA.MARCH/PAG 20080310	10/03/2008	C	971,36
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040KK4	BCA.MARCH/PAG 20080222	22/02/2008	C	986,62
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040KL2	BCA.MARCH/PAG 20080320	20/03/2008	C	976,14
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040KN8	BCA.MARCH/PAG 20080325	25/03/2008	C	977,70
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040KP3	BCA.MARCH/PAG 20080328	28/03/2008	C	977,46
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040KQ1	BCA.MARCH/PAG 20080331	31/03/2008	C	960,23
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040KV1	BCA.MARCH/PAG 20080402	02/04/2008	C	964,63
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040KX7	BCA.MARCH/PAG 20080408	08/04/2008	C	971,47
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040LB1	BCA.MARCH/PAG 20080414	14/04/2008	C	958,83
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040LF2	BCA.MARCH/PAG 20080418	18/04/2008	C	983,41
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040LH8	BCA.MARCH/PAG 20080422	22/04/2008	C	959,82
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040LM8	BCA.MARCH/PAG 20080430	30/04/2008	C	965,13
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040LO4	BCA.MARCH/PAG 20080505	05/05/2008	C	977,70
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040LR7	BCA.MARCH/PAG 20080312	12/03/2008	C	975,37
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040LY3	BCA.MARCH/PAG 20080520	20/05/2008	C	973,04
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040ME3	BCA.MARCH/PAG 20080523	23/05/2008	C	957,55
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040MJ2	BCA.MARCH/PAG 20080528	28/05/2008	C	959,03
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040MS3	BCA.MARCH/PAG 20080613	13/06/2008	C	957,62
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040MV7	BCA.MARCH/PAG 20080424	24/04/2008	C	963,13
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040MX3	BCA.MARCH/PAG 20080530	30/05/2008	C	968,34
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040NJ0	BCA.MARCH/PAG 20080102	02/01/2008	C	988,42
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040NK8	BCA.MARCH/PAG 20080702	02/07/2008	C	957,27
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040NO0	BCA.MARCH/PAG 20080109	09/01/2008	C	988,00
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040NP7	BCA.MARCH/PAG 20080114	14/01/2008	C	994,52
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040NT9	BCA.MARCH/PAG 20080121	21/01/2008	C	988,55
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040NW3	BCA.MARCH/PAG 20080123	23/01/2008	C	988,43
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040NX1	BCA.MARCH/PAG 20080721	21/07/2008	C	965,48
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040OA7	BCA.MARCH/PAG 20080128	28/01/2008	C	996,05
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040OB5	BCA.MARCH/PAG 20080125	25/01/2008	C	988,33
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040OC3	BCA.MARCH/PAG 20080131	31/01/2008	C	990,05
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040OE9	BCA.MARCH/PAG 20080206	06/02/2008	C	988,25
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040OF6	BCA.MARCH/PAG 20080208	08/02/2008	C	988,41
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040OG4	BCA.MARCH/PAG 20080211	11/02/2008	C	991,59
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040OJ8	BCA.MARCH/PAG 20080220	20/02/2008	C	988,42
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040OQ3	BCA.MARCH/PAG 20080901	01/09/2008	C	954,16
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040OV3	BCA.MARCH/PAG 20080905	05/09/2008	C	955,32
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040OY7	BCA.MARCH/PAG 20080908	08/09/2008	C	953,98
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040PB2	BCA.MARCH/PAG 20080314	14/03/2008	C	981,73
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040PC0	BCA.MARCH/PAG 20080912	12/09/2008	C	954,69
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040PE6	BCA.MARCH/PAG 20080317	17/03/2008	C	980,69
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040PF3	BCA.MARCH/PAG 20080915	15/09/2008	C	955,80
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040PH9	BCA.MARCH/PAG 20080326	26/03/2008	C	977,31
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040PJ5	BCA.MARCH/PAG 20080108	08/01/2008	C	992,36
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040PK3	BCA.MARCH/PAG 20080407	07/04/2008	C	976,88
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040PL1	BCA.MARCH/PAG 20080110	10/01/2008	C	995,21
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040PS6	BCA.MARCH/PAG 20080428	28/04/2008	C	977,37
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040PV0	BCA.MARCH/PAG 20081027	27/10/2008	C	956,05
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040PY4	BCA.MARCH/PAG 20080107	07/01/2008	C	995,88
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040PZ1	BCA.MARCH/PAG 20080509	09/05/2008	C	977,65
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040QA2	BCA.MARCH/PAG 20080212	12/02/2008	C	988,56
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040QD6	BCA.MARCH/PAG 20080213	13/02/2008	C	990,63
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040QE4	BCA.MARCH/PAG 20080215	15/02/2008	C	988,56
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040QI5	BCA.MARCH/PAG 20081117	17/11/2008	C	956,26
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040QJ3	BCA.MARCH/PAG 20080122	22/01/2008	C	995,78
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040QM7	BCA.MARCH/PAG 20080527	27/05/2008	C	977,06
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040QN5	BCA.MARCH/PAG 20080627	27/06/2008	C	973,29
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040QO3	BCA.MARCH/PAG 20081125	25/11/2008	C	955,44
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040QP0	BCA.MARCH/PAG 20080229	29/02/2008	C	988,16
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040QR6	BCA.MARCH/PAG 20080603	03/06/2008	C	976,41
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040QS4	BCA.MARCH/PAG 20080103	03/01/2008	C	997,13
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040QT2	BCA.MARCH/PAG 20081202	02/12/2008	C	954,74
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040QU0	BCA.MARCH/PAG 20080307	07/03/2008	C	987,89
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040QV8	BCA.MARCH/PAG 20080611	11/06/2008	C	975,99
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040QX4	BCA.MARCH/PAG 20080616	16/06/2008	C	975,35
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040RA0	BCA.MARCH/PAG 20080619	19/06/2008	C	975,62
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040RB8	BCA.MARCH/PAG 20081210	10/12/2008	C	953,80
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040RD4	BCA.MARCH/PAG 20080623	23/06/2008	C	976,34
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131415S4	AND/PAG 20080104	04/01/2008	C	2.959,51
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131416A0	AND/PAG 20080108	08/01/2008	C	2.946,19
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131416I3	AND/PAG 20080118	18/01/2008	C	2.985,74
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131416L7	AND/PAG 20080111	11/01/2008	C	2.976,92
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131416S2	AND/PAG 20080125	25/01/2008	C	2.937,50
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131417B6	AND/PAG 20080201	01/02/2008	C	2.881,84
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131417L5	AND/PAG 20080215	15/02/2008	C	2.973,60
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131417T8	AND/PAG 20080222	22/02/2008	C	2.945,29
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131417W2	AND/PAG 20080307	07/03/2008	C	2.884,72
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131417Y8	AND/PAG 20080314	14/03/2008	C	2.896,30
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131418B4	AND/PAG 20080328	28/03/2008	C	2.931,65
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131418G3	AND/PAG 20080326	26/03/2008	C	2.935,77
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131418J7	AND/PAG 20080402	02/04/2008	C	2.930,32
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131418N9	AND/PAG 20080411	11/04/2008	C	2.900,61
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131419C0	AND/PAG 20080425	25/04/2008	C	2.876,28
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131419J5	AND/PAG 20080502	02/05/2008	C	2.833,82
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131419R8	AND/PAG 20080516	16/05/2008	C	2.876,96
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513141A02	AND/PAG 20080530	30/05/2008	C	2.924,09



Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513141D74	AND/PAG 20080128	28/01/2008	C	2.988,04
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513141G48	AND/PAG 20080320	20/03/2008	C	2.938,26
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513141H05	AND/PAG 20080103	03/01/2008	C	2.991,39
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513141I79	AND/PAG 20080926	26/09/2008	C	2.870,36
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513141J60	AND/PAG 20080407	07/04/2008	C	2.930,56
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513141K34	AND/PAG 20080117	17/01/2008	C	2.987,44
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513141K83	AND/PAG 20081024	24/10/2008	C	2.878,75
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513141L25	AND/PAG 20080130	30/01/2008	C	2.976,32
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860S26	SAB/PAG 20081219	19/12/2008	C	941,64
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860TG4	SAB/PAG 20080229	29/02/2008	C	976,83
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860TP5	SAB/PAG 20080131	31/01/2008	C	970,29
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860TX9	SAB/PAG 20080104	04/01/2008	C	985,76
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860UD9	SAB/PAG 20080108	08/01/2008	C	987,68
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860UX7	SAB/PAG 20080121	21/01/2008	C	975,60
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860U22	SAB/PAG 20080730	30/07/2008	C	954,36
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860VH8	SAB/PAG 20080129	29/01/2008	C	982,50
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860VV9	SAB/PAG 20080208	08/02/2008	C	972,59
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860WA1	SAB/PAG 20080515	15/05/2008	C	976,34
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860WH6	SAB/PAG 20080408	08/04/2008	C	976,18
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860WM6	SAB/PAG 20080222	22/02/2008	C	979,72
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860WP9	SAB/PAG 20080306	06/03/2008	C	977,73
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860WX3	SAB/PAG 20080319	19/03/2008	C	987,44
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860XA9	SAB/PAG 20080320	20/03/2008	C	961,66
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860XB7	SAB/PAG 20080325	25/03/2008	C	983,12
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860XE1	SAB/PAG 20080331	31/03/2008	C	971,11
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860XK8	SAB/PAG 20080411	11/04/2008	C	974,75
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860XQ5	SAB/PAG 20080417	17/04/2008	C	977,54
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860XS1	SAB/PAG 20080428	28/04/2008	C	976,82
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860XX1	SAB/PAG 20080125	25/01/2008	C	981,52
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860YE9	SAB/PAG 20080201	01/02/2008	C	987,52
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860YF6	SAB/PAG 20080502	02/05/2008	C	977,33
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860YH2	SAB/PAG 20080507	07/05/2008	C	960,54
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860YN0	SAB/PAG 20080215	15/02/2008	C	988,70
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860Y08	SAB/PAG 20080716	16/07/2008	C	955,36
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860YT7	SAB/PAG 20080526	26/05/2008	C	958,17
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860YW1	SAB/PAG 20080522	22/05/2008	C	976,87
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860ZC0	SAB/PAG 20080527	27/05/2008	C	961,65
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860ZE6	SAB/PAG 20080530	30/05/2008	C	957,95
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860ZG1	SAB/PAG 20080404	04/04/2008	C	976,55
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860ZH9	SAB/PAG 20080605	05/06/2008	C	958,54
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860ZP2	SAB/PAG 20080310	10/03/2008	C	987,85
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860ZT4	SAB/PAG 20080115	15/01/2008	C	988,26
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860ZV0	SAB/PAG 20080613	13/06/2008	C	960,90
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860ZZ1	SAB/PAG 20080625	25/06/2008	C	976,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861015	SAB/PAG 20080627	27/06/2008	C	976,04
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861023	SAB/PAG 20080102	02/01/2008	C	998,28
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861049	SAB/PAG 20080714	14/07/2008	C	956,20
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861064	SAB/PAG 20080703	03/07/2008	C	962,09
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138610J2	SAB/PAG 20081223	23/12/2008	C	953,93
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861106	SAB/PAG 20080114	14/01/2008	C	993,15
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861148	SAB/PAG 20080111	11/01/2008	C	993,32
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861189	SAB/PAG 20080123	23/01/2008	C	988,34
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861197	SAB/PAG 20080124	24/01/2008	C	988,86
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861247	SAB/PAG 20080206	06/02/2008	C	988,81
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861346	SAB/PAG 20080825	25/08/2008	C	956,15
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861353	SAB/PAG 20080228	28/02/2008	C	980,94
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861403	SAB/PAG 20080103	03/01/2008	C	988,25
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861478	SAB/PAG 20080110	10/01/2008	C	994,73
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861486	SAB/PAG 20080101	10/01/2008	C	953,55
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861502	SAB/PAG 20080312	12/03/2008	C	987,69
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861528	SAB/PAG 20080117	17/01/2008	C	988,22
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861569	SAB/PAG 20080916	16/09/2008	C	955,63
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861577	SAB/PAG 20080128	28/01/2008	C	988,46
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861585	SAB/PAG 20080326	26/03/2008	C	987,44
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861593	SAB/PAG 20080926	26/09/2008	C	954,52
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861601	SAB/PAG 20080109	09/01/2008	C	989,58
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861619	SAB/PAG 20080328	28/03/2008	C	976,59
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861635	SAB/PAG 20080929	29/09/2008	C	957,04
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861650	SAB/PAG 20080118	18/01/2008	C	995,70
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861676	SAB/PAG 20080410	10/04/2008	C	976,47
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861692	SAB/PAG 20080211	11/02/2008	C	990,69
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861718	SAB/PAG 20080415	15/04/2008	C	976,75
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861726	SAB/PAG 20080116	16/01/2008	C	995,57
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861734	SAB/PAG 20080107	17/01/2008	C	959,83
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861742	SAB/PAG 20080122	22/01/2008	C	989,80
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861759	SAB/PAG 20080130	30/01/2008	C	988,59
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861783	SAB/PAG 20081028	28/10/2008	C	956,63
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861809	SAB/PAG 20080317	17/03/2008	C	988,15
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861817	SAB/PAG 20080204	04/02/2008	C	988,80
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861825	SAB/PAG 20080205	05/02/2008	C	989,88
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861833	SAB/PAG 20080225	25/02/2008	C	988,43
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861866	SAB/PAG 20081106	06/11/2008	C	957,52
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861874	SAB/PAG 20080313	13/03/2008	C	988,99
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861916	SAB/PAG 20080220	20/02/2008	C	991,89
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861924	SAB/PAG 20081117	17/11/2008	C	956,35
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861932	SAB/PAG 20080226	26/02/2008	C	989,87
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861940	SAB/PAG 20080227	27/02/2008	C	991,61
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861957	SAB/PAG 20080304	04/03/2008	C	988,65
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861965	SAB/PAG 20080620	20/06/2008	C	975,86
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861973	SAB/PAG 20081201	01/12/2008	C	954,57
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0513980005	BVA/PAG 20080104	04/01/2008	C	997,03
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0513980013	BVA/PAG 20080325	25/03/2008	C	987,48
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0513980021	BVA/PAG 20080110	10/01/2008	C	997,51
BANCO DE VASCONIA, S.A.	ES0513998E85	VAS/PAG 20080107	07/01/2008	C	2.986,27
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135804Q9	GUI/PAG 20080326	26/03/2008	C	974,92
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135805J3	GUI/PAG 20080131	31/01/2008	C	976,67
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135805J1	GUI/PAG 20080604	04/06/2008	C	974,94
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135805N3	GUI/PAG 20080611	11/06/2008	C	957,81

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135805O1	GUI/PAG 20080625	25/06/2008	C	969,55
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135805Q6	GUI/PAG 20080102	02/01/2008	C	968,35
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135805R4	GUI/PAG 20080109	09/01/2008	C	994,27
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135805S2	GUI/PAG 20080305	05/03/2008	C	978,12
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135805U8	GUI/PAG 20080116	16/01/2008	C	961,53
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135805W4	GUI/PAG 20080123	23/01/2008	C	990,01
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135805X2	GUI/PAG 20080130	30/01/2008	C	988,50
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135805Y0	GUI/PAG 20080723	23/07/2008	C	965,22
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135805Z7	GUI/PAG 20080213	13/02/2008	C	988,03
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806A8	GUI/PAG 20080220	20/02/2008	C	977,54
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806D2	GUI/PAG 20080813	13/08/2008	C	967,89
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806H3	GUI/PAG 20080312	12/03/2008	C	974,27
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806I1	GUI/PAG 20080319	19/03/2008	C	978,50
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806J9	GUI/PAG 20080910	10/09/2008	C	954,92
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806K7	GUI/PAG 20080317	17/03/2008	C	987,92
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806L5	GUI/PAG 20081001	01/10/2008	C	951,63
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806M3	GUI/PAG 20080416	16/04/2008	C	976,15
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806N1	GUI/PAG 20080423	23/04/2008	C	978,48
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806O9	GUI/PAG 20081008	08/10/2008	C	954,10
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806P6	GUI/PAG 20080430	30/04/2008	C	967,31
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806R2	GUI/PAG 20080507	07/05/2008	C	974,67
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806S0	GUI/PAG 20081022	22/10/2008	C	954,81
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806U6	GUI/PAG 20081105	05/11/2008	C	955,32
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806V4	GUI/PAG 20080521	21/05/2008	C	976,64
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806W2	GUI/PAG 20080528	28/05/2008	C	968,53
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135806X0	GUI/PAG 20081112	12/11/2008	C	956,48
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135807A6	GUI/PAG 20080618	18/06/2008	C	966,81
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135807B4	GUI/PAG 20081203	03/12/2008	C	955,46
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135807E8	GUI/PAG 20081217	17/12/2008	C	944,65
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135807G3	GUI/PAG 20080716	16/07/2008	C	959,71
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135807K5	GUI/PAG 20080206	06/02/2008	C	989,70
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135807M1	GUI/PAG 20080917	17/09/2008	C	955,27
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135807N9	GUI/PAG 20080924	24/09/2008	C	955,00
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135807P4	GUI/PAG 20080402	02/04/2008	C	977,51
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135807Q2	GUI/PAG 20080409	09/04/2008	C	976,72
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135807R0	GUI/PAG 20080428	28/04/2008	C	977,34
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135807S8	GUI/PAG 20081029	29/10/2008	C	955,87
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135807T6	GUI/PAG 20081030	30/10/2008	C	958,11
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770HB1	PAS/PAG 20080109	09/01/2008	C	962,99
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770OF8	PAS/PAG 20080822	22/08/2008	C	959,97
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770OJ0	PAS/PAG 20080312	12/03/2008	C	974,99
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770QC0	PAS/PAG 20081219	19/12/2008	C	944,41
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770QL1	PAS/PAG 20080305	05/03/2008	C	961,22
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770RE4	PAS/PAG 20080328	28/03/2008	C	961,53
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770RF1	PAS/PAG 20080930	30/09/2008	C	941,22
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770RH7	PAS/PAG 20080103	03/01/2008	C	982,15
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770RN5	PAS/PAG 20090109	09/01/2009	C	924,85
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770RP0	PAS/PAG 20080110	10/01/2008	C	988,52
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770RR6	PAS/PAG 20080530	30/05/2008	C	972,01
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770RV8	PAS/PAG 20080122	22/01/2008	C	992,38
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770SG7	PAS/PAG 20080201	01/02/2008	C	988,02
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770SK9	PAS/PAG 20080207	07/02/2008	C	960,86
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770SQ6	PAS/PAG 20080215	15/02/2008	C	980,85
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770SR4	PAS/PAG 20080218	18/02/2008	C	960,83
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770TA8	PAS/PAG 20081114	14/11/2008	C	957,14
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770TJ9	PAS/PAG 20090311	11/03/2009	C	922,85
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770UE8	PAS/PAG 20080414	14/04/2008	C	966,85
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770UM1	PAS/PAG 20080425	25/04/2008	C	959,62
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770UR0	PAS/PAG 20080507	07/05/2008	C	959,82
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770VJ5	PAS/PAG 20080605	05/06/2008	C	966,26
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770VQ0	PAS/PAG 20080616	16/06/2008	C	956,15
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770VR8	PAS/PAG 20080612	12/06/2008	C	968,67
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770VT4	PAS/PAG 20080619	19/06/2008	C	957,45
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770VZ1	PAS/PAG 20080104	04/01/2008	C	981,13
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770WA2	PAS/PAG 20080404	04/04/2008	C	968,16
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770WE4	PAS/PAG 20080709	09/07/2008	C	955,67
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770WM7	PAS/PAG 20080114	14/01/2008	C	990,79
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770WN5	PAS/PAG 20080716	16/07/2008	C	956,08
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770XA0	PAS/PAG 20080125	25/01/2008	C	980,13
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770XB8	PAS/PAG 20081016	16/10/2008	C	956,90
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770XG7	PAS/PAG 20080131	31/01/2008	C	978,87
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770XJ1	PAS/PAG 20080729	29/07/2008	C	956,96
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770XL7	PAS/PAG 20090119	19/01/2009	C	936,29
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770XR4	PAS/PAG 20080214	14/02/2008	C	983,81
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770XX2	PAS/PAG 20080307	07/03/2008	C	978,71
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770YS0	PAS/PAG 20080118	18/01/2008	C	988,39
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770ZA5	PAS/PAG 20080220	20/02/2008	C	991,83
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770ZL2	PAS/PAG 20080512	12/05/2008	C	977,91
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770ZP3	PAS/PAG 20080522	22/05/2008	C	977,93
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770ZW9	PAS/PAG 20080317	17/03/2008	C	987,93
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770ZY5	PAS/PAG 20080107	07/01/2008	C	996,10
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513783060	PAS/PAG 20081212	12/12/2008	C	953,14
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804AG2	POP/PAG 20080328	28/03/2008	C	2.879,47
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804A18	POP/PAG 20080326	26/03/2008	C	2.963,72
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804AQ1	POP/PAG 20080402	02/04/2008	C	2.959,91
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804AX7	POP/PAG 20080711	11/07/2008	C	2.883,86
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804AZ2	POP/PAG 20080320	20/03/2008	C	2.914,40
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804BA3	POP/PAG 20080411	11/04/2008	C	2.902,53
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804BE5	POP/PAG 20080418	18/04/2008	C	2.933,22
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804BJ4	POP/PAG 20080425	25/04/2008	C	2.919,34
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804BO4	POP/PAG 20080502	02/05/2008	C	2.933,96
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804BR7	POP/PAG 20080516	16/05/2008	C	2.920,98
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804BT3	POP/PAG 20080509	09/05/2008	C	2.875,94
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804BY3	POP/PAG 20080523	23/05/2008	C	2.906,58
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804CE3	POP/PAG 20080606	06/06/2008	C	2.877,10
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804CH6	POP/PAG 20080613	13/06/2008	C	2.926,53
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804CR5	POP/PAG 20080620	20/06/2008	C	2.929,41

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804CX3	POP/PAG 20080704	04/07/2008	C	2.868,85
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804DH4	POP/PAG 20080718	18/07/2008	C	2.876,11
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804DO0	POP/PAG 20080725	25/07/2008	C	2.906,96
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804DV5	POP/PAG 20080801	01/08/2008	C	2.869,40
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804EJ8	POP/PAG 20080103	03/01/2008	C	2.963,57
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804EK6	POP/PAG 20080912	12/09/2008	C	2.865,14
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804FI7	POP/PAG 20080926	26/09/2008	C	2.870,63
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804FJ5	POP/PAG 20081001	01/10/2008	C	2.885,62
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804FQ0	POP/PAG 20081002	02/10/2008	C	2.869,76
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804FV0	POP/PAG 20081024	24/10/2008	C	2.878,46
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804FZ1	POP/PAG 20080124	24/01/2008	C	2.988,44
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804GH7	POP/PAG 20081114	14/11/2008	C	2.870,20
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804GL9	POP/PAG 20080218	18/02/2008	C	2.974,70
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804GQ8	POP/PAG 20080228	28/02/2008	C	2.965,98
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804HB8	POP/PAG 20081212	12/12/2008	C	2.863,33
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804HJ1	POP/PAG 20081219	19/12/2008	C	2.866,19
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804K40	POP/PAG 20080104	04/01/2008	C	2.979,81
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804U97	POP/PAG 20080108	08/01/2008	C	2.887,14
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804V21	POP/PAG 20080111	11/01/2008	C	2.961,22
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804V54	POP/PAG 20080118	18/01/2008	C	2.941,44
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804W20	POP/PAG 20080125	25/01/2008	C	2.971,01
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804W95	POP/PAG 20080114	14/01/2008	C	2.990,93
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804X29	POP/PAG 20080201	01/02/2008	C	2.947,13
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804X52	POP/PAG 20080208	08/02/2008	C	2.962,26
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804Y10	POP/PAG 20080215	15/02/2008	C	2.887,86
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804Z35	POP/PAG 20080229	29/02/2008	C	2.931,84
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804Z76	POP/PAG 20080307	07/03/2008	C	2.883,51
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804Z84	POP/PAG 20080314	14/03/2008	C	2.930,45
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540122	BBE/PAG 20080114	14/01/2008	C	996,11
BANKINTER, S.A.	ES0513679EW7	BKT/PAG 20080320	20/03/2008	C	981,00
BANKINTER, S.A.	ES0513679FB8	BKT/PAG 20080125	25/01/2008	C	983,78
BANKINTER, S.A.	ES0513679FO1	BKT/PAG 20080418	18/04/2008	C	979,08
BANKINTER, S.A.	ES0513679GG5	BKT/PAG 20080520	20/05/2008	C	959,27
BANKINTER, S.A.	ES0513679HB4	BKT/PAG 20080620	20/06/2008	C	958,25
BANKINTER, S.A.	ES0513679HH1	BKT/PAG 20080919	19/09/2008	C	953,96
BANKINTER, S.A.	ES0513679HU4	BKT/PAG 20081219	19/12/2008	C	949,09
BANKINTER, S.A.	ES0513679HY6	BKT/PAG 20080305	05/03/2008	C	986,46
BANKINTER, S.A.	ES0513679IG1	BKT/PAG 20080220	20/02/2008	C	967,25
BANKINTER, S.A.	ES0513679II7	BKT/PAG 20080215	15/02/2008	C	988,09
BANKINTER, S.A.	ES0513679IJ5	BKT/PAG 20080820	20/08/2008	C	969,43
BANKINTER, S.A.	ES0513679IL1	BKT/PAG 20080208	08/02/2008	C	989,58
BANKINTER, S.A.	ES0513679IO5	BKT/PAG 20080402	02/04/2008	C	975,61
BANKINTER, S.A.	ES0513679IQ0	BKT/PAG 20081020	20/10/2008	C	957,14
BANKINTER, S.A.	ES0513679IV0	BKT/PAG 20080509	09/05/2008	C	961,23
BANKINTER, S.A.	ES0513679IX6	BKT/PAG 20080424	24/04/2008	C	974,90
BANKINTER, S.A.	ES0513679IY4	BKT/PAG 20080430	30/04/2008	C	962,72
BANKINTER, S.A.	ES0513679JD6	BKT/PAG 20081120	20/11/2008	C	950,23
BANKINTER, S.A.	ES0513679JG9	BKT/PAG 20080616	16/06/2008	C	975,46
BANKINTER, S.A.	ES0513679JH7	BKT/PAG 20090120	20/01/2009	C	934,52
BANKINTER, S.A.	ES0513679JN5	BKT/PAG 20080714	14/07/2008	C	961,38
BANKINTER, S.A.	ES0513679JO3	BKT/PAG 20080104	04/01/2008	C	990,86
BANKINTER, S.A.	ES0513679JR6	BKT/PAG 20090420	20/04/2009	C	926,95
BANKINTER, S.A.	ES0513679JV8	BKT/PAG 20080131	31/01/2008	C	990,37
BANKINTER, S.A.	ES0513679JZ9	BKT/PAG 20080603	03/06/2008	C	976,94
BANKINTER, S.A.	ES0513679KA0	BKT/PAG 20080229	29/02/2008	C	983,99
BANKINTER, S.A.	ES0513679KB8	BKT/PAG 20080901	01/09/2008	C	954,39
BANKINTER, S.A.	ES0513679KD4	BKT/PAG 20080317	17/03/2008	C	987,01
BANKINTER, S.A.	ES0513679KG7	BKT/PAG 20080328	28/03/2008	C	987,14
BANKINTER, S.A.	ES0513679KH5	BKT/PAG 20080929	29/09/2008	C	955,22
BANKINTER, S.A.	ES0513679KI3	BKT/PAG 20080627	27/06/2008	C	966,38
BANKINTER, S.A.	ES0513679KJ1	BKT/PAG 20081028	28/10/2008	C	957,13
BANKINTER, S.A.	ES0513679KM5	BKT/PAG 20081114	14/11/2008	C	956,84
BANKINTER, S.A.	ES0513679KO1	BKT/PAG 20081210	10/12/2008	C	953,48
BANKINTER, S.A.	ES0513679KP8	BKT/PAG 20080730	30/07/2008	C	969,84
BANKINTER, S.A.	ES0513679KQ6	BKT/PAG 20080118	18/01/2008	C	996,01
BANKINTER, S.A.	ES0513679KR4	BKT/PAG 20080314	14/03/2008	C	988,31
BANKINTER, S.A.	ES0513679KS2	BKT/PAG 20081212	12/12/2008	C	953,90
BANKINTER, S.A.	ES0513679KU8	BKT/PAG 20080111	11/01/2008	C	997,76
BANKOA, S.A.	ES05136764E0	BANKOA/PAG 20080328	28/03/2008	C	987,97
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424343	BBK EMPSTOS/PAG 20080116	16/01/2008	C	967,61
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424368	BBK EMPSTOS/PAG 20080118	18/01/2008	C	960,62
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424376	BBK EMPSTOS/PAG 20080130	30/01/2008	C	980,58
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424392	BBK EMPSTOS/PAG 20080206	06/02/2008	C	961,63
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424418	BBK EMPSTOS/PAG 20080104	04/01/2008	C	973,92
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424426	BBK EMPSTOS/PAG 20080305	05/03/2008	C	961,08
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424434	BBK EMPSTOS/PAG 20080208	08/02/2008	C	963,78
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424442	BBK EMPSTOS/PAG 20080312	12/03/2008	C	982,09
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424475	BBK EMPSTOS/PAG 20080402	02/04/2008	C	974,57
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424491	BBK EMPSTOS/PAG 20080418	18/04/2008	C	973,37
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424509	BBK EMPSTOS/PAG 20080424	24/04/2008	C	964,00
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424517	BBK EMPSTOS/PAG 20080505	05/05/2008	C	960,61
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424541	BBK EMPSTOS/PAG 20080530	30/05/2008	C	967,25
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424590	BBK EMPSTOS/PAG 20080610	10/06/2008	C	975,48
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424624	BBK EMPSTOS/PAG 20080227	27/02/2008	C	987,67
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424665	BBK EMPSTOS/PAG 20080714	14/07/2008	C	955,80
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424681	BBK EMPSTOS/PAG 20081016	16/10/2008	C	952,21
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424707	BBK EMPSTOS/PAG 20080317	17/03/2008	C	977,32
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424715	BBK EMPSTOS/PAG 20080922	22/09/2008	C	954,91
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424723	BBK EMPSTOS/PAG 20080328	28/03/2008	C	976,67
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424731	BBK EMPSTOS/PAG 20081003	03/10/2008	C	954,53
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424749	BBK EMPSTOS/PAG 20080407	07/04/2008	C	976,64
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424764	BBK EMPSTOS/PAG 20080428	28/04/2008	C	977,34
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424772	BBK EMPSTOS/PAG 20081024	24/10/2008	C	956,22

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424780	BBK.EMPTOS/PAG 20080507	07/05/2008	C	976,62
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424798	BBK.EMPTOS/PAG 20090109	09/01/2009	C	947,73
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136872T9	BBVAF/PAG 20080103	03/01/2008	C	980,58
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136872Z6	BBVAF/PAG 20080108	08/01/2008	C	961,09
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136873C3	BBVAF/PAG 20080114	14/01/2008	C	988,04
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136873D1	BBVAF/PAG 20080115	15/01/2008	C	964,70
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136873K6	BBVAF/PAG 20080125	25/01/2008	C	962,80
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136873M2	BBVAF/PAG 20080128	28/01/2008	C	963,59
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136873O8	BBVAF/PAG 20080129	29/01/2008	C	961,88
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136873Q3	BBVAF/PAG 20080130	30/01/2008	C	976,45
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136874A5	BBVAF/PAG 20080201	01/02/2008	C	966,36
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136874E7	BBVAF/PAG 20080207	07/02/2008	C	961,22
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136874F4	BBVAF/PAG 20080208	08/02/2008	C	960,95
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136874H0	BBVAF/PAG 20080211	11/02/2008	C	963,57
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136874J6	BBVAF/PAG 20080212	12/02/2008	C	960,46
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136874M0	BBVAF/PAG 20080215	15/02/2008	C	961,61
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136874P3	BBVAF/PAG 20080219	19/02/2008	C	970,03
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136874W9	BBVAF/PAG 20080228	28/02/2008	C	963,31
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136875B0	BBVAF/PAG 20080304	04/03/2008	C	962,56
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136875C8	BBVAF/PAG 20080305	05/03/2008	C	961,39
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136875J3	BBVAF/PAG 20080318	18/03/2008	C	960,36
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136875N5	BBVAF/PAG 20080110	10/01/2008	C	988,20
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136875O3	BBVAF/PAG 20080320	20/03/2008	C	965,10
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136875T2	BBVAF/PAG 20080328	28/03/2008	C	968,19
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136875U0	BBVAF/PAG 20080401	01/04/2008	C	962,07
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136875V8	BBVAF/PAG 20080402	02/04/2008	C	960,72
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136875Z9	BBVAF/PAG 20080410	10/04/2008	C	977,22
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136876G7	BBVAF/PAG 20080314	14/03/2008	C	973,21
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136876H5	BBVAF/PAG 20080422	22/04/2008	C	958,77
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136876I3	BBVAF/PAG 20080424	24/04/2008	C	960,16
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136876J1	BBVAF/PAG 20080425	25/04/2008	C	977,32
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136876L7	BBVAF/PAG 20080428	28/04/2008	C	959,80
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136876Q6	BBVAF/PAG 20080505	05/05/2008	C	960,81
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136876R4	BBVAF/PAG 20080507	07/05/2008	C	960,72
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136876Y0	BBVAF/PAG 20080520	20/05/2008	C	959,22
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136877A8	BBVAF/PAG 20080522	22/05/2008	C	959,06
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136877C4	BBVAF/PAG 20080528	28/05/2008	C	957,37
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136877H3	BBVAF/PAG 20080610	10/06/2008	C	957,71
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136877I1	BBVAF/PAG 20080612	12/06/2008	C	958,42
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136877N1	BBVAF/PAG 20080613	13/06/2008	C	957,67
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136877R2	BBVAF/PAG 20080618	18/06/2008	C	959,61
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136877T8	BBVAF/PAG 20080619	19/06/2008	C	958,88
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136877W2	BBVAF/PAG 20080623	23/06/2008	C	956,59
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136878C2	BBVAF/PAG 20080630	30/06/2008	C	961,93
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136878F5	BBVAF/PAG 20080702	02/07/2008	C	956,54
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136878G3	BBVAF/PAG 20080107	07/01/2008	C	997,73
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136878H1	BBVAF/PAG 20080627	27/06/2008	C	958,63
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136878I9	BBVAF/PAG 20080703	03/07/2008	C	956,59
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136878J7	BBVAF/PAG 20080117	17/01/2008	C	978,62
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136878K5	BBVAF/PAG 20080131	31/01/2008	C	977,80
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136878M1	BBVAF/PAG 20080714	14/07/2008	C	956,43
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136878P4	BBVAF/PAG 20080602	02/06/2008	C	962,97
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136878Q2	BBVAF/PAG 20080718	18/07/2008	C	956,50
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136878R0	BBVAF/PAG 20080121	21/01/2008	C	978,49
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136878S8	BBVAF/PAG 20080124	24/01/2008	C	978,69
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136878U4	BBVAF/PAG 20080724	24/07/2008	C	958,81
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136878V2	BBVAF/PAG 20080430	30/04/2008	C	971,73
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136879B2	BBVAF/PAG 20080214	14/02/2008	C	979,60
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136879L1	BBVAF/PAG 20080912	12/09/2008	C	954,73
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136879M9	BBVAF/PAG 20080317	17/03/2008	C	980,68
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136879O5	BBVAF/PAG 20080918	18/09/2008	C	955,84
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136879R8	BBVAF/PAG 20080925	25/09/2008	C	954,92
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136879S6	BBVAF/PAG 20080109	09/01/2008	C	987,97
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136879U2	BBVAF/PAG 20080929	29/09/2008	C	955,80
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136879W8	BBVAF/PAG 20080930	30/09/2008	C	954,47
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136879X6	BBVAF/PAG 20080104	04/01/2008	C	988,85
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136879Y4	BBVAF/PAG 20081002	02/10/2008	C	956,27
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687A02	BBVAF/PAG 20080407	07/04/2008	C	976,89
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687A10	BBVAF/PAG 20080408	08/04/2008	C	976,82
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687A51	BBVAF/PAG 20080416	16/04/2008	C	976,58
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687A69	BBVAF/PAG 20081016	16/10/2008	C	957,34
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687B01	BBVAF/PAG 20080122	22/01/2008	C	989,28
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687B19	BBVAF/PAG 20081020	20/10/2008	C	956,57
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687B43	BBVAF/PAG 20081024	24/10/2008	C	956,39
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687B68	BBVAF/PAG 20080725	25/07/2008	C	967,56
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687B76	BBVAF/PAG 20081028	28/10/2008	C	958,26
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687C67	BBVAF/PAG 20081110	10/11/2008	C	957,97
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDR	ES05149583N0	CAIXANOVA/PAG 20080425	25/04/2008	C	976,64
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDR	ES05149583R1	CAIXANOVA/PAG 20080508	08/05/2008	C	979,34
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDR	ES05149584G2	CAIXANOVA/PAG 20080125	25/01/2008	C	990,26
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDR	ES05149584N8	CAIXANOVA/PAG 20080529	29/05/2008	C	976,62
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDR	ES05149584T5	CAIXANOVA/PAG 20080404	04/04/2008	C	976,40
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDR	ES05149584U3	CAIXANOVA/PAG 20080204	04/02/2008	C	983,98
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDR	ES05149584Z2	CAIXANOVA/PAG 20080129	29/01/2008	C	990,18
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDR	ES05149585B0	CAIXANOVA/PAG 20080430	30/04/2008	C	977,84
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDR	ES05149585D6	CAIXANOVA/PAG 20080609	09/06/2008	C	976,32
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDR	ES05149585E4	CAIXANOVA/PAG 20080521	21/05/2008	C	976,74
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDR	ES05149585H7	CAIXANOVA/PAG 20080229	29/02/2008	C	988,07
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDR	ES05149585M7	CAIXANOVA/PAG 20081117	17/11/2008	C	956,55
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AA8	CA.CATALUNYA/PAG 20080625	25/06/2008	C	48.655,98
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AC4	CA.CATALUNYA/PAG 20080102	02/01/2008	C	49.374,05
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AD2	CA.CATALUNYA/PAG 20080702	02/07/2008	C	47.798,38
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AF7	CA.CATALUNYA/PAG 20080709	09/07/2008	C	47.835,19

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AH3	CA.CATALUNYA/PAG 20080109	09/01/2008	C	49.611,72
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AI1	CA.CATALUNYA/PAG 20090121	21/01/2009	C	46.687,61
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AJ9	CA.CATALUNYA/PAG 20081015	15/10/2008	C	47.860,52
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AK7	CA.CATALUNYA/PAG 20080130	30/01/2008	C	49.383,51
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AM3	CA.CATALUNYA/PAG 20080305	05/03/2008	C	49.271,89
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AN1	CA.CATALUNYA/PAG 20080910	10/09/2008	C	47.738,35
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AO9	CA.CATALUNYA/PAG 20080917	17/09/2008	C	47.777,44
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AP6	CA.CATALUNYA/PAG 20080924	24/09/2008	C	47.779,68
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AQ4	CA.CATALUNYA/PAG 20081001	01/10/2008	C	47.785,98
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AR2	CA.CATALUNYA/PAG 20081112	12/11/2008	C	47.706,42
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AS0	CA.CATALUNYA/PAG 20080116	16/01/2008	C	49.391,52
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AT8	CA.CATALUNYA/PAG 20081008	08/10/2008	C	47.756,11
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AV4	CA.CATALUNYA/PAG 20081029	29/10/2008	C	47.877,88
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AW2	CA.CATALUNYA/PAG 20080730	30/07/2008	C	48.317,73
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AX0	CA.CATALUNYA/PAG 20081105	05/11/2008	C	47.773,19
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AY8	CA.CATALUNYA/PAG 20080514	14/05/2008	C	48.864,74
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840AZ5	CA.CATALUNYA/PAG 20080213	13/02/2008	C	49.434,05
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840BB4	CA.CATALUNYA/PAG 20081126	26/11/2008	C	47.762,92
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840BD0	CA.CATALUNYA/PAG 20081210	10/12/2008	C	47.696,54
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840BE8	CA.CATALUNYA/PAG 20081203	03/12/2008	C	47.737,58
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840BF5	CA.CATALUNYA/PAG 20081224	24/12/2008	C	47.666,54
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840T37	CA.CATALUNYA/PAG 20080131	31/01/2008	C	48.511,89
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840T60	CA.CATALUNYA/PAG 20080103	03/01/2008	C	48.490,39
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840T78	CA.CATALUNYA/PAG 20080306	06/03/2008	C	48.049,20
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840T86	CA.CATALUNYA/PAG 20080207	07/02/2008	C	48.060,97
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840U00	CA.CATALUNYA/PAG 20080124	24/01/2008	C	48.021,49
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840U26	CA.CATALUNYA/PAG 20080206	06/02/2008	C	49.671,80
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840U34	CA.CATALUNYA/PAG 20080220	20/02/2008	C	49.295,15
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840V09	CA.CATALUNYA/PAG 20080227	27/02/2008	C	49.428,31
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840W16	CA.CATALUNYA/PAG 20080312	12/03/2008	C	48.883,66
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840W57	CA.CATALUNYA/PAG 20080903	03/09/2008	C	47.694,74
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840W81	CA.CATALUNYA/PAG 20080319	19/03/2008	C	48.920,99
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840X07	CA.CATALUNYA/PAG 20080813	13/08/2008	C	47.226,81
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840X15	CA.CATALUNYA/PAG 20080326	26/03/2008	C	48.836,88
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840X31	CA.CATALUNYA/PAG 20080416	16/04/2008	C	48.149,13
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840X49	CA.CATALUNYA/PAG 20080402	02/04/2008	C	48.776,53
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840X80	CA.CATALUNYA/PAG 20080409	09/04/2008	C	48.844,63
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840Y14	CA.CATALUNYA/PAG 20080423	23/04/2008	C	48.298,03
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840Y30	CA.CATALUNYA/PAG 20080430	30/04/2008	C	48.258,41
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840Y48	CA.CATALUNYA/PAG 20080507	07/05/2008	C	48.839,21
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840Y89	CA.CATALUNYA/PAG 20080618	18/06/2008	C	48.782,61
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840Z13	CA.CATALUNYA/PAG 20080521	21/05/2008	C	48.638,24
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840Z47	CA.CATALUNYA/PAG 20080827	27/08/2008	C	47.719,26
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840Z54	CA.CATALUNYA/PAG 20080528	28/05/2008	C	48.577,21
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840Z62	CA.CATALUNYA/PAG 20080604	04/06/2008	C	48.370,15
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840Z88	CA.CATALUNYA/PAG 20080611	11/06/2008	C	48.493,16
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249336	CA.GIRONA/PAG 20080116	16/01/2008	C	987,80
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249401	CA.GIRONA/PAG 20080305	05/03/2008	C	981,45
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249419	CA.GIRONA/PAG 20080312	12/03/2008	C	977,11
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249427	CA.GIRONA/PAG 20080409	09/04/2008	C	972,67
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249500	CA.GIRONA/PAG 20080611	11/06/2008	C	975,49
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249518	CA.GIRONA/PAG 20080326	26/03/2008	C	976,81
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249526	CA.GIRONA/PAG 20080625	25/06/2008	C	956,32
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249583	CA.GIRONA/PAG 20080227	27/02/2008	C	977,44
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249591	CA.GIRONA/PAG 20080827	27/08/2008	C	954,50
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249609	CA.GIRONA/PAG 20080130	30/01/2008	C	980,74
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249617	CA.GIRONA/PAG 20080903	03/09/2008	C	953,87
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249625	CA.GIRONA/PAG 20081015	15/10/2008	C	952,55
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249633	CA.GIRONA/PAG 20080910	10/09/2008	C	955,38
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249641	CA.GIRONA/PAG 20080917	17/09/2008	C	955,50
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249658	CA.GIRONA/PAG 20080521	21/05/2008	C	968,69
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249666	CA.GIRONA/PAG 20080723	23/07/2008	C	961,12
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249740	CA.GIRONA/PAG 20080507	07/05/2008	C	977,20
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249757	CA.GIRONA/PAG 20080123	23/01/2008	C	996,63
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249765	CA.GIRONA/PAG 20080604	04/06/2008	C	976,35
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249773	CA.GIRONA/PAG 20081203	03/12/2008	C	954,70
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249799	CA.GIRONA/PAG 20080618	18/06/2008	C	975,67
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249815	CA.GIRONA/PAG 20080716	16/07/2008	C	972,88
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850454	CA.MANRESA/PAG 20080313	13/03/2008	C	976,48
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850470	CA.MANRESA/PAG 20080325	25/03/2008	C	976,66
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850488	CA.MANRESA/PAG 20080922	22/09/2008	C	954,92
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850512	CA.MANRESA/PAG 20080505	05/05/2008	C	972,50
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850538	CA.MANRESA/PAG 20081009	09/10/2008	C	955,12
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850546	CA.MANRESA/PAG 20080417	17/04/2008	C	977,41
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850561	CA.MANRESA/PAG 20080424	24/04/2008	C	977,16
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850579	CA.MANRESA/PAG 20081030	30/10/2008	C	955,53
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850587	CA.MANRESA/PAG 20080214	14/02/2008	C	988,69
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850595	CA.MANRESA/PAG 20080516	16/05/2008	C	977,39
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850603	CA.MANRESA/PAG 20080530	30/05/2008	C	976,78
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850611	CA.MANRESA/PAG 20080616	16/06/2008	C	975,84
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850637	CA.MANRESA/PAG 20081204	04/12/2008	C	954,69
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973033	CA.SABADELL/PAG 20080319	19/03/2008	C	977,55
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973132	CA.SABADELL/PAG 20080107	07/01/2008	C	961,23
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973157	CA.SABADELL/PAG 20080404	04/04/2008	C	979,32
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973165	CA.SABADELL/PAG 20080527	27/05/2008	C	957,50
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973173	CA.SABADELL/PAG 20080922	22/09/2008	C	957,41
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973199	CA.SABADELL/PAG 20080430	30/04/2008	C	977,18
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973215	CA.SABADELL/PAG 20080125	25/01/2008	C	993,44
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346502	CA.TARRAGONA/PAG 20080114	14/01/2008	C	990,52
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346569	CA.TARRAGONA/PAG 20080228	28/02/2008	C	977,90
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346577	CA.TARRAGONA/PAG 20080414	14/04/2008	C	977,85
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346585	CA.TARRAGONA/PAG 20080128	28/01/2008	C	987,96
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346593	CA.TARRAGONA/PAG 20080213	13/02/2008	C	982,83
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346601	CA.TARRAGONA/PAG 20080328	28/03/2008	C	976,59
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346619	CA.TARRAGONA/PAG 20080528	28/05/2008	C	969,74
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346627	CA.TARRAGONA/PAG 20080828	28/08/2008	C	954,77
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346635	CA.TARRAGONA/PAG 20080313	13/03/2008	C	978,55
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346643	CA.TARRAGONA/PAG 20080905	05/09/2008	C	954,50
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346650	CA.TARRAGONA/PAG 20080910	10/09/2008	C	954,88
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346676	CA.TARRAGONA/PAG 20080104	04/01/2008	C	988,19
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346684	CA.TARRAGONA/PAG 20080926	26/09/2008	C	955,40
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346692	CA.TARRAGONA/PAG 20080613	13/06/2008	C	975,74

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346700	CA.TARRAGONA/PAG 20080407	07/04/2008	C	976,59
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346718	CA.TARRAGONA/PAG 20080428	28/04/2008	C	976,98
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346726	CA.TARRAGONA/PAG 20080506	06/05/2008	C	977,42
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346734	CA.TARRAGONA/PAG 20081106	06/11/2008	C	955,32
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346759	CA.TARRAGONA/PAG 20081128	28/11/2008	C	954,94
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346767	CA.TARRAGONA/PAG 20081219	19/12/2008	C	954,07
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149660A3	CA.PENEDES/PAG 20080430	30/04/2008	C	974,49
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149660C9	CA.PENEDES/PAG 20080423	23/04/2008	C	958,92
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149660D7	CA.PENEDES/PAG 20081015	15/10/2008	C	946,33
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149660F2	CA.PENEDES/PAG 20080507	07/05/2008	C	958,75
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149660J4	CA.PENEDES/PAG 20080514	14/05/2008	C	964,85
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149660K2	CA.PENEDES/PAG 20080521	21/05/2008	C	977,27
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149660M8	CA.PENEDES/PAG 20080530	30/05/2008	C	961,85
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149660N6	CA.PENEDES/PAG 20080604	04/06/2008	C	962,79
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149660P1	CA.PENEDES/PAG 20080625	25/06/2008	C	961,97
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149660U1	CA.PENEDES/PAG 20080716	16/07/2008	C	956,45
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149660W7	CA.PENEDES/PAG 20080130	30/01/2008	C	983,45
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149660X5	CA.PENEDES/PAG 20080319	19/03/2008	C	981,96
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149661A1	CA.PENEDES/PAG 20080814	14/08/2008	C	961,54
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149661E3	CA.PENEDES/PAG 20080903	03/09/2008	C	953,89
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149661F0	CA.PENEDES/PAG 20080910	10/09/2008	C	954,60
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149661G8	CA.PENEDES/PAG 20080917	17/09/2008	C	955,82
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149661H6	CA.PENEDES/PAG 20080402	02/04/2008	C	976,51
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149661I4	CA.PENEDES/PAG 20080523	23/05/2008	C	977,42
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149661J2	CA.PENEDES/PAG 20081203	03/12/2008	C	954,55
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149661M6	CA.PENEDES/PAG 20081217	17/12/2008	C	953,52
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966763	CA.PENEDES/PAG 20080611	11/06/2008	C	967,51
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966789	CA.PENEDES/PAG 20080102	02/01/2008	C	960,75
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966797	CA.PENEDES/PAG 20080630	30/06/2008	C	956,00
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966847	CA.PENEDES/PAG 20080118	18/01/2008	C	975,83
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966854	CA.PENEDES/PAG 20080227	27/02/2008	C	984,07
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966862	CA.PENEDES/PAG 20080123	23/01/2008	C	985,81
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966904	CA.PENEDES/PAG 20080206	06/02/2008	C	960,53
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966920	CA.PENEDES/PAG 20080208	08/02/2008	C	991,94
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966938	CA.PENEDES/PAG 20080214	14/02/2008	C	961,47
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966946	CA.PENEDES/PAG 20080730	30/07/2008	C	956,22
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966979	CA.PENEDES/PAG 20080328	28/03/2008	C	959,57
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966987	CA.PENEDES/PAG 20080403	03/04/2008	C	959,89
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966995	CA.PENEDES/PAG 20080416	16/04/2008	C	968,20
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846015	CA.LAIETANA/PAG 20080221	21/02/2008	C	979,69
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846031	CA.LAIETANA/PAG 20080522	22/05/2008	C	968,57
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846049	CA.LAIETANA/PAG 20080724	24/07/2008	C	961,00
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846056	CA.LAIETANA/PAG 20080918	18/09/2008	C	955,20
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846064	CA.LAIETANA/PAG 20080320	20/03/2008	C	976,93
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846072	CA.LAIETANA/PAG 20081016	16/10/2008	C	956,01
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846098	CA.LAIETANA/PAG 20080403	03/04/2008	C	975,55
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846106	CA.LAIETANA/PAG 20081002	02/10/2008	C	955,21
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846114	CA.LAIETANA/PAG 20080110	10/01/2008	C	988,30
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846148	CA.LAIETANA/PAG 20081009	09/10/2008	C	954,76
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846163	CA.LAIETANA/PAG 20080424	24/04/2008	C	977,05
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846171	CA.LAIETANA/PAG 20080124	24/01/2008	C	989,05
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846189	CA.LAIETANA/PAG 20080508	08/05/2008	C	976,32
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846197	CA.LAIETANA/PAG 20080619	19/06/2008	C	974,93
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846205	CA.LAIETANA/PAG 20081023	23/10/2008	C	956,47
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846213	CA.LAIETANA/PAG 20081106	06/11/2008	C	955,62
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846221	CA.LAIETANA/PAG 20081113	13/11/2008	C	956,07
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846254	CA.LAIETANA/PAG 20081204	04/12/2008	C	954,55
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0514826769	CAJASTUR/PAG 20080229	29/02/2008	C	49.402,33
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0514826777	CAJASTUR/PAG 20080307	07/03/2008	C	49.380,79
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0514826850	CAJASTUR/PAG 20080530	30/05/2008	C	48.834,14
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0514826868	CAJASTUR/PAG 20081121	21/11/2008	C	47.794,62
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0514826892	CAJASTUR/PAG 20081128	28/11/2008	C	47.747,97
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0514826900	CAJASTUR/PAG 20081205	05/12/2008	C	47.712,78
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0514826918	CAJASTUR/PAG 20080606	06/06/2008	C	48.816,53
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0514826926	CAJASTUR/PAG 20080613	13/06/2008	C	48.808,92
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154240B4	CCM/PAG 20080104	04/01/2008	C	97.056,87
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154240E8	CCM/PAG 20080118	18/01/2008	C	98.648,95
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154240K5	CCM/PAG 20080213	13/02/2008	C	98.659,24
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154240L3	CCM/PAG 20080225	25/02/2008	C	98.810,29
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154240M1	CCM/PAG 20080325	25/03/2008	C	96.164,64
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154240N9	CCM/PAG 20080415	15/04/2008	C	97.682,84
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154240O7	CCM/PAG 20080526	26/05/2008	C	97.556,60
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154240Q2	CCM/PAG 20080625	25/06/2008	C	97.541,62
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154240S8	CCM/PAG 20080811	11/08/2008	C	96.457,51
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154240T6	CCM/PAG 20080314	14/03/2008	C	97.920,44
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154240U4	CCM/PAG 20080910	10/09/2008	C	95.900,52
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154240V2	CCM/PAG 20080925	25/09/2008	C	95.885,06
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154240W0	CCM/PAG 20080425	25/04/2008	C	97.704,08
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154240X8	CCM/PAG 20080515	15/05/2008	C	97.723,52
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154240Y6	CCM/PAG 20081110	10/11/2008	C	95.679,33
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154241A4	CCM/PAG 20081125	25/11/2008	C	95.528,95
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154241B2	CCM/PAG 20080616	16/06/2008	C	97.535,23
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154241C0	CCM/PAG 20081210	10/12/2008	C	95.457,65
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148430M7	CAIXAGALICIA/PAG 20080102	02/01/2008	C	984,61
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148430Z9	CAIXAGALICIA/PAG 20081219	19/12/2008	C	948,74
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431D4	CAIXAGALICIA/PAG 20080328	28/03/2008	C	968,09
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431E2	CAIXAGALICIA/PAG 20080121	21/01/2008	C	987,02
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431F9	CAIXAGALICIA/PAG 20080425	25/04/2008	C	972,58
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431G7	CAIXAGALICIA/PAG 20080204	04/02/2008	C	983,83
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431H5	CAIXAGALICIA/PAG 20080215	15/02/2008	C	977,15
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431I3	CAIXAGALICIA/PAG 20080225	25/02/2008	C	985,41
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431J1	CAIXAGALICIA/PAG 20080306	06/03/2008	C	978,97
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431K9	CAIXAGALICIA/PAG 20080917	17/09/2008	C	951,59
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431L7	CAIXAGALICIA/PAG 20080320	20/03/2008	C	971,47
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431O1	CAIXAGALICIA/PAG 20080407	07/04/2008	C	975,11
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431Q6	CAIXAGALICIA/PAG 20080417	17/04/2008	C	967,86
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431R4	CAIXAGALICIA/PAG 20080507	07/05/2008	C	977,55
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431S2	CAIXAGALICIA/PAG 20081016	16/10/2008	C	953,32
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431T0	CAIXAGALICIA/PAG 20080522	22/05/2008	C	970,71
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431V6	CAIXAGALICIA/PAG 20081124	24/11/2008	C	953,74
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431W4	CAIXAGALICIA/PAG 20080530	30/05/2008	C	969,07
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431X2	CAIXAGALICIA/PAG 20080606	06/06/2008	C	972,89
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431Y0	CAIXAGALICIA/PAG 20080618	18/06/2008	C	968,70
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431Z7	CAIXAGALICIA/PAG 20090617	17/06/2009	C	919,17

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432A8	CAIXAGALICIA/PAG 20080627	27/06/2008	C	966,77
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432B6	CAIXAGALICIA/PAG 20080704	04/07/2008	C	962,11
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432D2	CAIXAGALICIA/PAG 20080715	15/07/2008	C	968,72
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432E0	CAIXAGALICIA/PAG 20080728	28/07/2008	C	961,52
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432G5	CAIXAGALICIA/PAG 20080814	14/08/2008	C	964,46
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432H3	CAIXAGALICIA/PAG 20080905	05/09/2008	C	957,32
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432I1	CAIXAGALICIA/PAG 20080925	25/09/2008	C	959,86
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432K7	CAIXAGALICIA/PAG 20080929	29/09/2008	C	958,89
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432L5	CAIXAGALICIA/PAG 20080326	26/03/2008	C	987,77
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432M3	CAIXAGALICIA/PAG 20090403	03/04/2009	C	933,15
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432O9	CAIXAGALICIA/PAG 20081027	27/10/2008	C	955,88
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432P6	CAIXAGALICIA/PAG 20090122	22/01/2009	C	948,67
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432Q4	CAIXAGALICIA/PAG 20081114	14/11/2008	C	955,67
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432S0	CAIXAGALICIA/PAG 20081210	10/12/2008	C	953,68
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432T8	CAIXAGALICIA/PAG 20091016	16/10/2009	C	917,89
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148450P8	CAI/PAG 20080625	25/06/2008	C	95.599,94
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148450T0	CAI/PAG 20080828	28/08/2008	C	95.412,75
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148450U8	CAI/PAG 20080902	02/09/2008	C	95.389,62
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148450V6	CAI/PAG 20080306	06/03/2008	C	97.632,65
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148450W4	CAI/PAG 20080710	10/07/2008	C	96.113,92
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148450Y0	CAI/PAG 20081001	01/10/2008	C	96.051,61
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148450Z7	CAI/PAG 20080401	01/04/2008	C	97.630,71
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148451A8	CAI/PAG 20081008	08/10/2008	C	95.655,95
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148451B6	CAI/PAG 20081120	20/11/2008	C	95.537,46
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148451C4	CAI/PAG 20081126	26/11/2008	C	95.524,71
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148451D2	CAI/PAG 20081204	04/12/2008	C	95.436,69
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148451E0	CAI/PAG 20080606	06/06/2008	C	97.622,89
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155300T7	CA.RIOJA/PAG 20080328	28/03/2008	C	97.661,00
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155300V3	CA.RIOJA/PAG 20080410	10/04/2008	C	97.652,24
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155300W1	CA.RIOJA/PAG 20080509	09/05/2008	C	97.726,33
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155300X9	CA.RIOJA/PAG 20080516	16/05/2008	C	97.735,02
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155300Y7	CA.RIOJA/PAG 20080228	28/02/2008	C	98.829,32
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155300Z4	CA.RIOJA/PAG 20080602	02/06/2008	C	97.661,09
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155301A5	CA.RIOJA/PAG 20080625	25/06/2008	C	97.419,33
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155301B3	CA.RIOJA/PAG 20081215	15/12/2008	C	95.272,85
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146002H6	CA.MURCIA/PAG 20080218	18/02/2008	C	980,87
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146002K0	CA.MURCIA/PAG 20080313	13/03/2008	C	984,11
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146002L8	CA.MURCIA/PAG 20080326	26/03/2008	C	980,66
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146002M6	CA.MURCIA/PAG 20080102	02/01/2008	C	985,52
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146002R5	CA.MURCIA/PAG 20080424	24/04/2008	C	960,56
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146002T1	CA.MURCIA/PAG 20080430	30/04/2008	C	959,77
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146002X3	CA.MURCIA/PAG 20080605	05/06/2008	C	971,33
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146002Z8	CA.MURCIA/PAG 20080530	30/05/2008	C	974,45
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146003A9	CA.MURCIA/PAG 20080626	26/06/2008	C	957,08
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146003B7	CA.MURCIA/PAG 20080128	28/01/2008	C	991,55
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146003D3	CA.MURCIA/PAG 20080828	28/08/2008	C	954,27
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146003I2	CA.MURCIA/PAG 20080417	17/04/2008	C	976,53
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146003L6	CA.MURCIA/PAG 20080508	08/05/2008	C	977,36
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146003N2	CA.MURCIA/PAG 20080521	21/05/2008	C	977,32
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148545I0	CAJADUERO/PAG 20080104	04/01/2008	C	964,60
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148545L4	CAJADUERO/PAG 20080115	15/01/2008	C	964,66
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148545P5	CAJADUERO/PAG 20080215	15/02/2008	C	971,31
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148545T7	CAJADUERO/PAG 20080305	05/03/2008	C	976,50
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148545Z4	CAJADUERO/PAG 20080326	26/03/2008	C	971,29
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148546H0	CAJADUERO/PAG 20080409	09/04/2008	C	974,32
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148546P3	CAJADUERO/PAG 20080430	30/04/2008	C	969,51
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148547D7	CAJADUERO/PAG 20080613	13/06/2008	C	975,18
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148547E5	CAJADUERO/PAG 20080508	08/05/2008	C	976,44
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148547F2	CAJADUERO/PAG 20080626	26/06/2008	C	962,32
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148547I6	CAJADUERO/PAG 20080107	07/01/2008	C	989,89
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148547J4	CAJADUERO/PAG 20080404	04/04/2008	C	974,61
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148547N6	CAJADUERO/PAG 20080414	14/04/2008	C	976,86
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148547S5	CAJADUERO/PAG 20080128	28/01/2008	C	988,01
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148547U1	CAJADUERO/PAG 20080131	31/01/2008	C	988,18
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148547W7	CAJADUERO/PAG 20080201	01/02/2008	C	989,70
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148548D5	CAJADUERO/PAG 20080208	08/02/2008	C	989,87
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148548E3	CAJADUERO/PAG 20080828	28/08/2008	C	956,63
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148548K0	CAJADUERO/PAG 20080211	11/02/2008	C	982,99
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148548M6	CAJADUERO/PAG 20080912	12/09/2008	C	955,40
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148548N4	CAJADUERO/PAG 20080317	17/03/2008	C	976,53
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148548Q7	CAJADUERO/PAG 20080922	22/09/2008	C	955,62
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148548R5	CAJADUERO/PAG 20080307	07/03/2008	C	988,56
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148548S3	CAJADUERO/PAG 20080929	29/09/2008	C	956,31
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148548V7	CAJADUERO/PAG 20080403	03/04/2008	C	986,24
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148548Y1	CAJADUERO/PAG 20080408	08/04/2008	C	978,10
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148548Z8	CAJADUERO/PAG 20080108	08/01/2008	C	993,49
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148549A9	CAJADUERO/PAG 20080116	16/01/2008	C	990,73
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148549B7	CAJADUERO/PAG 20080421	21/04/2008	C	977,06
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148549C5	CAJADUERO/PAG 20080111	11/01/2008	C	991,78
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148549D3	CAJADUERO/PAG 20080125	25/01/2008	C	995,59
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148549E1	CAJADUERO/PAG 20080225	25/02/2008	C	986,50
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148549G6	CAJADUERO/PAG 20081028	28/10/2008	C	955,69
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148549H4	CAJADUERO/PAG 20081030	30/10/2008	C	957,31
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148549J0	CAJADUERO/PAG 20080220	20/02/2008	C	988,95
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148549L6	CAJADUERO/PAG 20081117	17/11/2008	C	956,55
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148549M4	CAJADUERO/PAG 20080527	27/05/2008	C	976,94
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148549Q9	CAJADUERO/PAG 20081223	23/12/2008	C	954,18
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149753I5	CA.CANTABRIA/PAG 20080206	06/02/2008	C	9.812,08
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149753K5	CA.CANTABRIA/PAG 20080313	13/03/2008	C	9.775,69
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149753O7	CA.CANTABRIA/PAG 20080603	03/06/2008	C	9.585,64
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149753Q2	CA.CANTABRIA/PAG 20080103	03/01/2008	C	9.615,66
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149753R0	CA.CANTABRIA/PAG 20080124	24/01/2008	C	9.835,51
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149753Z3	CA.CANTABRIA/PAG 20080912	12/09/2008	C	9.598,75
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149754C0	CA.CANTABRIA/PAG 20080328	28/03/2008	C	9.799,50
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149754F3	CA.CANTABRIA/PAG 20080411	11/04/2008	C	9.593,56

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149754H9	CA.CANTABRIA/PAG 20080430	30/04/2008	C	9.592,85
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149754I7	CA.CANTABRIA/PAG 20080829	29/08/2008	C	9.460,72
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149754J5	CA.CANTABRIA/PAG 20081128	28/11/2008	C	9.461,77
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149754K3	CA.CANTABRIA/PAG 20081219	19/12/2008	C	9.454,88
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149754L1	CA.CANTABRIA/PAG 20081016	16/10/2008	C	9.555,12
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149754Q0	CA.CANTABRIA/PAG 20080403	03/04/2008	C	9.765,52
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149754R8	CA.CANTABRIA/PAG 20080110	10/01/2008	C	9.878,80
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149754S6	CA.CANTABRIA/PAG 20081111	11/11/2008	C	9.574,85
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149754T4	CA.CANTABRIA/PAG 20080627	27/06/2008	C	9.733,76
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149754U2	CA.CANTABRIA/PAG 20080527	27/05/2008	C	9.772,78
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778D7	BANCAJA/PAG 20080104	04/01/2008	C	967,81
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778E5	BANCAJA/PAG 20080110	10/01/2008	C	980,72
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778F2	BANCAJA/PAG 20080125	25/01/2008	C	991,16
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778H8	BANCAJA/PAG 20080131	31/01/2008	C	962,67
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778J4	BANCAJA/PAG 20080208	08/02/2008	C	980,41
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778K2	BANCAJA/PAG 20080225	25/02/2008	C	983,12
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778L0	BANCAJA/PAG 20080310	10/03/2008	C	977,23
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778N6	BANCAJA/PAG 20080325	25/03/2008	C	966,85
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778P1	BANCAJA/PAG 20080410	10/04/2008	C	960,46
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778Q9	BANCAJA/PAG 20080422	22/04/2008	C	978,19
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778R7	BANCAJA/PAG 20080425	25/04/2008	C	977,10
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778T3	BANCAJA/PAG 20080430	30/04/2008	C	958,62
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778U1	BANCAJA/PAG 20080508	08/05/2008	C	977,23
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778V9	BANCAJA/PAG 20080509	09/05/2008	C	977,00
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778W7	BANCAJA/PAG 20080514	14/05/2008	C	959,72
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778X5	BANCAJA/PAG 20080519	19/05/2008	C	957,89
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149778Y3	BANCAJA/PAG 20080523	23/05/2008	C	975,97
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779A1	BANCAJA/PAG 20080606	06/06/2008	C	969,64
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779B9	BANCAJA/PAG 20080610	10/06/2008	C	960,05
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779D5	BANCAJA/PAG 20080616	16/06/2008	C	975,78
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779E3	BANCAJA/PAG 20080625	25/06/2008	C	963,43
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779G8	BANCAJA/PAG 20080702	02/07/2008	C	957,15
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779I4	BANCAJA/PAG 20080710	10/07/2008	C	963,53
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779K0	BANCAJA/PAG 20080723	23/07/2008	C	960,18
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779L8	BANCAJA/PAG 20080725	25/07/2008	C	966,96
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779N4	BANCAJA/PAG 20080822	22/08/2008	C	958,61
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779O2	BANCAJA/PAG 20080825	25/08/2008	C	955,91
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779P9	BANCAJA/PAG 20080910	10/09/2008	C	956,15
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779Q7	BANCAJA/PAG 20080915	15/09/2008	C	955,75
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779R5	BANCAJA/PAG 20080317	17/03/2008	C	981,21
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779S3	BANCAJA/PAG 20080925	25/09/2008	C	962,66
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779T1	BANCAJA/PAG 20080403	03/04/2008	C	976,41
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779U9	BANCAJA/PAG 20080407	07/04/2008	C	976,62
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779V7	BANCAJA/PAG 20080408	08/04/2008	C	976,49
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779W5	BANCAJA/PAG 20081010	10/10/2008	C	958,71
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779X3	BANCAJA/PAG 20080314	14/03/2008	C	981,77
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779Y1	BANCAJA/PAG 20080428	28/04/2008	C	977,27
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES05149779Z8	BANCAJA/PAG 20081028	28/10/2008	C	957,25
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0514977A09	BANCAJA/PAG 20081110	10/11/2008	C	957,07
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0514977A17	BANCAJA/PAG 20080128	28/01/2008	C	992,25
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0514977A25	BANCAJA/PAG 20080530	30/05/2008	C	976,84
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0514977A33	BANCAJA/PAG 20080108	08/01/2008	C	995,67
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0514977A41	BANCAJA/PAG 20081205	05/12/2008	C	954,55
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICA	ES0514977A58	BANCAJA/PAG 20081209	09/12/2008	C	953,67
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0515308833	CA.VITAL/PAG 20080508	08/05/2008	C	97.725,27
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0515308874	CA.VITAL/PAG 20080407	07/04/2008	C	96.174,65
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0515308882	CA.VITAL/PAG 20080424	24/04/2008	C	96.380,92
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0515308890	CA.VITAL/PAG 20080515	15/05/2008	C	97.665,55
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0515308924	CA.VITAL/PAG 20080110	10/01/2008	C	97.877,01
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0515308932	CA.VITAL/PAG 20080124	24/01/2008	C	99.521,41
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0515308965	CA.VITAL/PAG 20080925	25/09/2008	C	95.463,32
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0515308981	CA.VITAL/PAG 20081016	16/10/2008	C	95.448,45
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144005S8	CAM/PAG 20080103	03/01/2008	C	970,71
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144005U4	CAM/PAG 20080110	10/01/2008	C	977,18
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144005V2	CAM/PAG 20080117	17/01/2008	C	991,34
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144005W0	CAM/PAG 20080327	27/03/2008	C	970,51
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144005X8	CAM/PAG 20080124	24/01/2008	C	962,76
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144005Y6	CAM/PAG 20080424	24/04/2008	C	959,46
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144005Z3	CAM/PAG 20080207	07/02/2008	C	984,25
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144006B2	CAM/PAG 20080703	03/07/2008	C	944,35
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144006C0	CAM/PAG 20080214	14/02/2008	C	992,26
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144006G1	CAM/PAG 20080228	28/02/2008	C	978,24
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144006H9	CAM/PAG 20080306	06/03/2008	C	975,69
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144006I7	CAM/PAG 20080313	13/03/2008	C	977,68
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144006L1	CAM/PAG 20080410	10/04/2008	C	960,18
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144006N7	CAM/PAG 20080508	08/05/2008	C	977,26
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144006P2	CAM/PAG 20080522	22/05/2008	C	967,82
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144006V0	CAM/PAG 20080612	12/06/2008	C	975,28
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144006Z1	CAM/PAG 20081016	16/10/2008	C	956,64
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144007A2	CAM/PAG 20080925	25/09/2008	C	954,53
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144007C8	CAM/PAG 20080904	04/09/2008	C	953,75
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144007D6	CAM/PAG 20080828	28/08/2008	C	954,64
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144007E4	CAM/PAG 20080911	11/09/2008	C	954,60
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144007F1	CAM/PAG 20080918	18/09/2008	C	955,52
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144007G9	CAM/PAG 20080724	24/07/2008	C	968,80
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144007L9	CAM/PAG 20090108	08/01/2009	C	949,77
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144007M7	CAM/PAG 20081204	04/12/2008	C	954,69
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149612P2	CA.BURGOS/PAG 20080515	15/05/2008	C	972,51
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149612U2	CA.BURGOS/PAG 20080102	02/01/2008	C	963,49
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149612W8	CA.BURGOS/PAG 20080115	15/01/2008	C	984,75
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149612X6	CA.BURGOS/PAG 20080201	01/02/2008	C	960,08



Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149612Y4	CA.BURGOS/PAG 20080215	15/02/2008	C	962,88
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149612Z1	CA.BURGOS/PAG 20080303	03/03/2008	C	961,43
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149613C8	CA.BURGOS/PAG 20080401	01/04/2008	C	968,70
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149613D6	CA.BURGOS/PAG 20080415	15/04/2008	C	981,92
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149613J3	CA.BURGOS/PAG 20080201	01/02/2008	C	9.776,35
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149613K1	CA.BURGOS/PAG 20080701	01/07/2008	C	9.635,96
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149613L9	CA.BURGOS/PAG 20080715	15/07/2008	C	9.704,65
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149613M7	CA.BURGOS/PAG 20080102	02/01/2008	C	9.890,83
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149613N5	CA.BURGOS/PAG 20080215	15/02/2008	C	9.835,55
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149613O3	CA.BURGOS/PAG 20081015	15/10/2008	C	9.582,95
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149613P0	CA.BURGOS/PAG 20080415	15/04/2008	C	9.779,99
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149613Q8	CA.BURGOS/PAG 20080303	03/03/2008	C	9.765,99
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149613R6	CA.BURGOS/PAG 20080901	01/09/2008	C	9.590,49
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149613T2	CA.BURGOS/PAG 20080915	15/09/2008	C	9.581,92
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149613X4	CA.BURGOS/PAG 20080401	01/04/2008	C	9.764,24
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149613Y2	CA.BURGOS/PAG 20081001	01/10/2008	C	9.538,85
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149614A0	CA.BURGOS/PAG 20081125	25/11/2008	C	9.514,48
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149614B8	CA.BURGOS/PAG 20090115	15/01/2009	C	9.487,52
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149614D4	CA.BURGOS/PAG 20080505	05/05/2008	C	9.773,42
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149614E2	CA.BURGOS/PAG 20081103	03/11/2008	C	9.566,68
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149614F9	CA.BURGOS/PAG 20080515	15/05/2008	C	9.774,18
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149614G7	CA.BURGOS/PAG 20081117	17/11/2008	C	9.562,92
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149614H5	CA.BURGOS/PAG 20081215	15/12/2008	C	9.526,28
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910019	CA.AVILA/PAG 20080118	18/01/2008	C	98.345,44
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910027	CA.AVILA/PAG 20080124	24/01/2008	C	98.488,26
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910068	CA.AVILA/PAG 20080903	03/09/2008	C	95.367,48
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910076	CA.AVILA/PAG 20080211	11/02/2008	C	98.402,99
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910084	CA.AVILA/PAG 20080430	30/04/2008	C	97.723,43
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910092	CA.AVILA/PAG 20080507	07/05/2008	C	97.679,63
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910100	CA.AVILA/PAG 20080205	05/02/2008	C	98.837,34
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910118	CA.AVILA/PAG 20080515	15/05/2008	C	97.733,09
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910134	CA.AVILA/PAG 20080527	27/05/2008	C	97.686,78
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910142	CA.AVILA/PAG 20081125	25/11/2008	C	95.525,46
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0514926791	SA.NOSTRA/PAG 20080430	30/04/2008	C	9.590,20
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0514926809	SA.NOSTRA/PAG 20080418	18/04/2008	C	9.775,60
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0514926825	SA.NOSTRA/PAG 20080514	14/05/2008	C	9.728,37
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0514926833	SA.NOSTRA/PAG 20080222	22/02/2008	C	9.808,03
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0514926874	SA.NOSTRA/PAG 20080915	15/09/2008	C	9.582,71
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0514926890	SA.NOSTRA/PAG 20081002	02/10/2008	C	9.551,16
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0514926908	SA.NOSTRA/PAG 20080208	08/02/2008	C	9.884,59
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0514926916	SA.NOSTRA/PAG 20080212	12/02/2008	C	9.886,86
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0514926957	SA.NOSTRA/PAG 20080312	12/03/2008	C	9.876,87
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES05647300B1	CAJASUR/PAG 20080619	19/06/2008	C	97.551,80
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0564730622	CAJASUR/PAG 20080118	18/01/2008	C	96.098,11
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0564730663	CAJASUR/PAG 20080131	31/01/2008	C	96.379,11
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0564730721	CAJASUR/PAG 20080312	12/03/2008	C	97.026,05
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0564730762	CAJASUR/PAG 20080411	11/04/2008	C	97.719,75
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0564730812	CAJASUR/PAG 20080425	25/04/2008	C	97.163,89
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0564730853	CAJASUR/PAG 20080507	07/05/2008	C	97.515,36
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0564730903	CAJASUR/PAG 20080530	30/05/2008	C	95.874,60
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0564730978	CAJASUR/PAG 20080916	16/09/2008	C	95.496,29
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0564730994	CAJASUR/PAG 20080314	14/03/2008	C	98.171,27
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES05149506T8	CA.MADRID/PAG 20080304	04/03/2008	C	976,71
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES05149506U6	CA.MADRID/PAG 20080107	07/01/2008	C	991,47
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES05149506W2	CA.MADRID/PAG 20080111	11/01/2008	C	987,83
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES05149506X0	CA.MADRID/PAG 20080313	13/03/2008	C	976,60
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES05149507Y6	CA.MADRID/PAG 20081016	16/10/2008	C	955,51
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES05149508L1	CA.MADRID/PAG 20080109	09/01/2008	C	997,63
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES05149508V0	CA.MADRID/PAG 20081209	09/12/2008	C	954,60
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES05149508W8	CA.MADRID/PAG 20080317	17/03/2008	C	988,43
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149656A1	CAN/PAG 20080304	04/03/2008	C	97.547,60
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149656B9	CAN/PAG 20080108	08/01/2008	C	98.644,21
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149656E3	CAN/PAG 20080115	15/01/2008	C	98.344,87
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149656F0	CAN/PAG 20080122	22/01/2008	C	97.748,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149656G8	CAN/PAG 20080422	22/04/2008	C	97.343,38
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149656I4	CAN/PAG 20080129	29/01/2008	C	96.087,59
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149656K0	CAN/PAG 20080212	12/02/2008	C	97.993,51
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149656M6	CAN/PAG 20080219	19/02/2008	C	98.962,87
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149656Q7	CAN/PAG 20080916	16/09/2008	C	94.122,08
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149656R5	CAN/PAG 20080318	18/03/2008	C	97.669,16
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149656T1	CAN/PAG 20080923	23/09/2008	C	94.278,15
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149656U9	CAN/PAG 20080401	01/04/2008	C	96.900,45
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149656V7	CAN/PAG 20080415	15/04/2008	C	97.712,10
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149656W5	CAN/PAG 20080506	06/05/2008	C	97.675,92
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149656Y1	CAN/PAG 20080520	20/05/2008	C	97.686,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149656Z8	CAN/PAG 20080603	03/06/2008	C	95.678,23
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657A9	CAN/PAG 20080527	27/05/2008	C	97.347,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657B7	CAN/PAG 20080610	10/06/2008	C	96.679,77
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657C5	CAN/PAG 20080624	24/06/2008	C	96.711,58
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657F8	CAN/PAG 20081216	16/12/2008	C	95.366,47
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657G6	CAN/PAG 20081021	21/10/2008	C	95.722,03
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657H4	CAN/PAG 20080902	02/09/2008	C	95.854,94
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657I2	CAN/PAG 20080311	11/03/2008	C	98.645,58
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657J0	CAN/PAG 20080909	09/09/2008	C	96.116,22
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657K8	CAN/PAG 20080325	25/03/2008	C	98.204,32
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657L6	CAN/PAG 20081111	11/11/2008	C	95.559,04
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657M4	CAN/PAG 20080408	08/04/2008	C	97.649,02
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657N2	CAN/PAG 20080226	26/02/2008	C	98.234,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657O0	CAN/PAG 20081028	28/10/2008	C	95.573,22
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657P7	CAN/PAG 20081104	04/11/2008	C	95.619,51
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657Q5	CAN/PAG 20080513	13/05/2008	C	97.763,05
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657R3	CAN/PAG 20081118	18/11/2008	C	95.553,88
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657S1	CAN/PAG 20080617	17/06/2008	C	97.571,65
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657T9	CAN/PAG 20090113	13/01/2009	C	94.966,83
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657U7	CAN/PAG 20081202	02/12/2008	C	95.465,14
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES0514954009	IBERCAJA/PAG 20080117	17/01/2008	C	993,40
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES0514954074	IBERCAJA/PAG 20080320	20/03/2008	C	987,57
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES0514954140	IBERCAJA/PAG 20080327	27/03/2008	C	976,58
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES0514954157	IBERCAJA/PAG 20080619	19/06/2008	C	975,45

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ/ES0514954207	ES0514954207	IBERCAJA/PAG 20080110	10/01/2008	C	993,04
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ/ES0514954264	ES0514954264	IBERCAJA/PAG 20080424	24/04/2008	C	977,18
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ/ES0514954322	ES0514954322	IBERCAJA/PAG 20080508	08/05/2008	C	977,32
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ/ES0514954348	ES0514954348	IBERCAJA/PAG 20081106	06/11/2008	C	956,29
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ/ES0514954355	ES0514954355	IBERCAJA/PAG 20080124	24/01/2008	C	992,81
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ/ES0514954371	ES0514954371	IBERCAJA/PAG 20080131	31/01/2008	C	991,86
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ/ES0514954389	ES0514954389	IBERCAJA/PAG 20080529	29/05/2008	C	976,84
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ/ES0514954447	ES0514954447	IBERCAJA/PAG 20080313	13/03/2008	C	987,55
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ/ES0514954462	ES0514954462	IBERCAJA/PAG 20080612	12/06/2008	C	976,35
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134668	ES0515134668	CAJACIRCULO/PAG 20080115	15/01/2008	C	98.849,75
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134718	ES0515134718	CAJACIRCULO/PAG 20080318	18/03/2008	C	96.830,28
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134734	ES0515134734	CAJACIRCULO/PAG 20080415	15/04/2008	C	96.972,58
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134742	ES0515134742	CAJACIRCULO/PAG 20080422	22/04/2008	C	97.245,65
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134759	ES0515134759	CAJACIRCULO/PAG 20080408	08/04/2008	C	97.136,32
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134767	ES0515134767	CAJACIRCULO/PAG 20080527	27/05/2008	C	95.912,50
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134775	ES0515134775	CAJACIRCULO/PAG 20080610	10/06/2008	C	96.064,30
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134809	ES0515134809	CAJACIRCULO/PAG 20081028	28/10/2008	C	95.222,72
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134825	ES0515134825	CAJACIRCULO/PAG 20080826	26/08/2008	C	95.446,98
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134833	ES0515134833	CAJACIRCULO/PAG 20080325	25/03/2008	C	97.351,02
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134841	ES0515134841	CAJACIRCULO/PAG 20080304	04/03/2008	C	97.653,61
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134858	ES0515134858	CAJACIRCULO/PAG 20080902	02/09/2008	C	95.387,94
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134866	ES0515134866	CAJACIRCULO/PAG 20080311	11/03/2008	C	97.793,59
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134874	ES0515134874	CAJACIRCULO/PAG 20080909	09/09/2008	C	95.533,50
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134882	ES0515134882	CAJACIRCULO/PAG 20080930	30/09/2008	C	95.359,53
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134890	ES0515134890	CAJACIRCULO/PAG 20080916	16/09/2008	C	95.562,99
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134908	ES0515134908	CAJACIRCULO/PAG 20081014	14/10/2008	C	95.448,08
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134916	ES0515134916	CAJACIRCULO/PAG 20080506	06/05/2008	C	97.707,06
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134924	ES0515134924	CAJACIRCULO/PAG 20081216	16/12/2008	C	95.018,58
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134940	ES0515134940	CAJACIRCULO/PAG 20081111	11/11/2008	C	95.572,53
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134957	ES0515134957	CAJACIRCULO/PAG 20081118	18/11/2008	C	95.603,91
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134973	ES0515134973	CAJACIRCULO/PAG 20081202	02/12/2008	C	95.457,26
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO ES0515134981	ES0515134981	CAJACIRCULO/PAG 20080624	24/06/2008	C	97.487,12
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970426	ES0514970426	LACAIXA/PAG 20080328	28/03/2008	C	978,08
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES05149706K3	ES05149706K3	LACAIXA/PAG 20080610	10/06/2008	C	960,28
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES05149707A2	ES05149707A2	LACAIXA/PAG 20080729	29/07/2008	C	963,58
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES05149707F1	ES05149707F1	LACAIXA/PAG 20080812	12/08/2008	C	952,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES05149707V8	ES05149707V8	LACAIXA/PAG 20080916	16/09/2008	C	963,80
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES05149708A0	ES05149708A0	LACAIXA/PAG 20080923	23/09/2008	C	961,88
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES05149708H5	ES05149708H5	LACAIXA/PAG 20081012	02/10/2008	C	993,08
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES05149708R4	ES05149708R4	LACAIXA/PAG 20080603	03/06/2008	C	959,26
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES05149708U8	ES05149708U8	LACAIXA/PAG 20081018	08/10/2008	C	997,58
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES05149708Z7	ES05149708Z7	LACAIXA/PAG 20080408	08/04/2008	C	975,36
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES05149709A8	ES05149709A8	LACAIXA/PAG 20081007	07/10/2008	C	951,49
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES05149709G5	ES05149709G5	LACAIXA/PAG 20081021	21/10/2008	C	956,02
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES05149709Q4	ES05149709Q4	LACAIXA/PAG 20080304	04/03/2008	C	980,92
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES05149709T8	ES05149709T8	LACAIXA/PAG 20080226	26/02/2008	C	987,41
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970A22	ES0514970A22	LACAIXA/PAG 20080129	29/01/2008	C	967,95
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970B88	ES0514970B88	LACAIXA/PAG 20080104	04/01/2008	C	991,15
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970C38	ES0514970C38	LACAIXA/PAG 20080115	15/01/2008	C	994,06
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970C53	ES0514970C53	LACAIXA/PAG 20080708	08/07/2008	C	972,98
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970C61	ES0514970C61	LACAIXA/PAG 20080122	22/01/2008	C	982,59
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970C95	ES0514970C95	LACAIXA/PAG 20080219	19/02/2008	C	981,43
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970D03	ES0514970D03	LACAIXA/PAG 20080617	17/06/2008	C	969,99
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970D78	ES0514970D78	LACAIXA/PAG 20080205	05/02/2008	C	990,98
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970E02	ES0514970E02	LACAIXA/PAG 20080415	15/04/2008	C	981,63
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970E10	ES0514970E10	LACAIXA/PAG 20080527	27/05/2008	C	961,06
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970E77	ES0514970E77	LACAIXA/PAG 20080207	07/02/2008	C	990,20
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970F27	ES0514970F27	LACAIXA/PAG 20080215	15/02/2008	C	989,09
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970F43	ES0514970F43	LACAIXA/PAG 20080208	08/02/2008	C	990,16
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970F84	ES0514970F84	LACAIXA/PAG 20080311	11/03/2008	C	982,82
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970G34	ES0514970G34	LACAIXA/PAG 20080121	21/01/2008	C	990,70
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970G42	ES0514970G42	LACAIXA/PAG 20090324	24/03/2009	C	923,23
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970G59	ES0514970G59	LACAIXA/PAG 20080305	05/03/2008	C	961,41
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970G75	ES0514970G75	LACAIXA/PAG 20080422	22/04/2008	C	965,07
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970H82	ES0514970H82	LACAIXA/PAG 20080401	01/04/2008	C	987,39
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970I32	ES0514970I32	LACAIXA/PAG 20090421	21/04/2009	C	919,36
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970I73	ES0514970I73	LACAIXA/PAG 20080320	20/03/2008	C	980,04
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970J07	ES0514970J07	LACAIXA/PAG 20080715	15/07/2008	C	965,63
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970K12	ES0514970K12	LACAIXA/PAG 20080513	13/05/2008	C	967,68
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970K79	ES0514970K79	LACAIXA/PAG 20080520	20/05/2008	C	974,72
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970L29	ES0514970L29	LACAIXA/PAG 20080701	01/07/2008	C	968,75
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970N50	ES0514970N50	LACAIXA/PAG 20080722	22/07/2008	C	960,58
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970O83	ES0514970O83	LACAIXA/PAG 20080805	05/08/2008	C	967,66
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970R49	ES0514970R49	LACAIXA/PAG 20080829	29/08/2008	C	954,49
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970R64	ES0514970R64	LACAIXA/PAG 20080103	03/01/2008	C	997,32
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970R72	ES0514970R72	LACAIXA/PAG 20080229	29/02/2008	C	980,68
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970U02	ES0514970U02	LACAIXA/PAG 20080109	09/01/2008	C	992,86
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970V19	ES0514970V19	LACAIXA/PAG 20080118	18/01/2008	C	995,95
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970V68	ES0514970V68	LACAIXA/PAG 20080214	14/02/2008	C	989,17
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA ES0514970X09	ES0514970X09	LACAIXA/PAG 20080131	31/01/2008	C	994,71
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154741T3	ES05154741T3	CA.ESPAÑA/PAG 20080109	09/01/2008	C	9.697,80
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154741U1	ES05154741U1	CA.ESPAÑA/PAG 20080103	03/01/2008	C	9.613,97
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154741X5	ES05154741X5	CA.ESPAÑA/PAG 20080124	24/01/2008	C	9.604,42
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154741Z0	ES05154741Z0	CA.ESPAÑA/PAG 20080131	31/01/2008	C	9.606,50
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154742E3	ES05154742E3	CA.ESPAÑA/PAG 20080208	08/02/2008	C	9.857,31
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154742K0	ES05154742K0	CA.ESPAÑA/PAG 20080306	06/03/2008	C	9.750,69
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154742P9	ES05154742P9	CA.ESPAÑA/PAG 20080409	09/04/2008	C	9.729,03
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154742T1	ES05154742T1	CA.ESPAÑA/PAG 20080424	24/04/2008	C	9.597,21
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154742V7	ES05154742V7	CA.ESPAÑA/PAG 20080430	30/04/2008	C	9.762,70
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154742Y1	ES05154742Y1	CA.ESPAÑA/PAG 20080530	30/05/2008	C	9.744,13
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154742Z8	ES05154742Z8	CA.ESPAÑA/PAG 20080616	16/06/2008	C	9.757,89
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154743A9	ES05154743A9	CA.ESPAÑA/PAG 20080613	13/06/2008	C	9.574,99
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154743C5	ES05154743C5	CA.ESPAÑA/PAG 20080107	07/01/2008	C	9.873,85
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154743H4	ES05154743H4	CA.ESPAÑA/PAG 20081016	16/10/2008	C	9.566,32
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154743L6	ES05154743L6	CA.ESPAÑA/PAG 20080221	21/02/2008	C	9.862,84
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154743N2	ES05154743N2	CA.ESPAÑA/PAG 20080902	02/09/2008	C	9.539,77
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y ES05154743O0	ES05154743O0	CA.ESPAÑA/PAG 20080313	13/03/2008	C	9.765,25

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES05154743P7	CA.ESPAÑA/PAG 20080912	12/09/2008	C	9.546,02
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES05154743Q5	CA.ESPAÑA/PAG 20080314	14/03/2008	C	9.777,26
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES05154743R3	CA.ESPAÑA/PAG 20080922	22/09/2008	C	9.550,46
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES05154743S1	CA.ESPAÑA/PAG 20080929	29/09/2008	C	9.576,42
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES05154743T9	CA.ESPAÑA/PAG 20080403	03/04/2008	C	9.764,57
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES05154743U7	CA.ESPAÑA/PAG 20080407	07/04/2008	C	9.766,63
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES05154743V5	CA.ESPAÑA/PAG 20080425	25/04/2008	C	9.772,52
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES05154743W3	CA.ESPAÑA/PAG 20080204	04/02/2008	C	9.871,99
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES05154743X1	CA.ESPAÑA/PAG 20081030	30/10/2008	C	9.569,14
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES05154743Y9	CA.ESPAÑA/PAG 20080502	02/05/2008	C	9.771,22
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES05154744A7	CA.ESPAÑA/PAG 20080521	21/05/2008	C	9.769,92
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES05154744B5	CA.ESPAÑA/PAG 20081117	17/11/2008	C	9.554,33
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES05154744D1	CA.ESPAÑA/PAG 20080528	28/05/2008	C	9.768,11
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES05154744E9	CA.ESPAÑA/PAG 20080605	05/06/2008	C	9.763,28
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES05154744G4	CA.ESPAÑA/PAG 20080611	11/06/2008	C	9.759,44
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y	ES05154744H2	CA.ESPAÑA/PAG 20081205	05/12/2008	C	9.545,72
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514981TN3	CAJACANARIAS/PAG 20080111	11/01/2008	C	987,94
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514981TU8	CAJACANARIAS/PAG 20080118	18/01/2008	C	992,02
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514981US0	CAJACANARIAS/PAG 20080215	15/02/2008	C	992,62
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514981VA6	CAJACANARIAS/PAG 20080229	29/02/2008	C	988,14
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514981VB4	CAJACANARIAS/PAG 20080307	07/03/2008	C	978,25
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514981WN7	CAJACANARIAS/PAG 20080516	16/05/2008	C	977,77
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514981XE4	CAJACANARIAS/PAG 20080620	20/06/2008	C	976,15
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149821L8	CA.GRANADA/PAG 20080430	30/04/2008	C	95.914,79
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149821M6	CA.GRANADA/PAG 20080407	07/04/2008	C	97.118,56
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149821R5	CA.GRANADA/PAG 20080104	04/01/2008	C	98.858,45
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149821W5	CA.GRANADA/PAG 20080905	05/09/2008	C	95.619,14
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149821X3	CA.GRANADA/PAG 20080320	20/03/2008	C	97.660,23
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149821Y1	CA.GRANADA/PAG 20080919	19/09/2008	C	95.540,19
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149821Z8	CA.GRANADA/PAG 20080121	21/01/2008	C	98.673,66
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149822A9	CA.GRANADA/PAG 20080421	21/04/2008	C	97.720,77
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149822B7	CA.GRANADA/PAG 20080520	20/05/2008	C	97.741,20
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149822C5	CA.GRANADA/PAG 20080220	20/02/2008	C	98.933,15
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149822D3	CA.GRANADA/PAG 20081205	05/12/2008	C	95.457,20
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149822E1	CA.GRANADA/PAG 20080620	20/06/2008	C	97.600,20
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149830F1	LA.CAJA/PAG 20080528	28/05/2008	C	95.744,89
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149830L9	LA.CAJA/PAG 20080424	24/04/2008	C	96.305,48
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149831X2	LA.CAJA/PAG 20080424	24/04/2008	C	48.840,72
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149832A8	LA.CAJA/PAG 20080125	25/01/2008	C	49.587,35
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149832E0	LA.CAJA/PAG 20080507	07/05/2008	C	48.862,79
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149832J9	LA.CAJA/PAG 20081120	20/11/2008	C	47.817,81
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149832L5	LA.CAJA/PAG 20080221	21/02/2008	C	49.458,14
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149832Y8	LA.CAJA/PAG 20081212	12/12/2008	C	47.662,96
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149832Z5	LA.CAJA/PAG 20080612	12/06/2008	C	48.791,69
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153065B6	CR.NAVARRA/PAG 20080116	16/01/2008	C	9.905,32
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153065D2	CR.NAVARRA/PAG 20080123	23/01/2008	C	9.719,72
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153065E0	CR.NAVARRA/PAG 20080109	09/01/2008	C	9.874,30
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153065G5	CR.NAVARRA/PAG 20080213	13/02/2008	C	9.858,51
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153065H1	CR.NAVARRA/PAG 20080206	06/02/2008	C	9.807,67
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153065K7	CR.NAVARRA/PAG 20080227	27/02/2008	C	9.612,71
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153065M3	CR.NAVARRA/PAG 20080312	12/03/2008	C	9.769,34
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153065S0	CR.NAVARRA/PAG 20080416	16/04/2008	C	9.598,36
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153065X0	CR.NAVARRA/PAG 20080430	30/04/2008	C	9.772,44
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153065Y8	CR.NAVARRA/PAG 20080514	14/05/2008	C	9.635,87
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153066B4	CR.NAVARRA/PAG 20080521	21/05/2008	C	9.597,14
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153066G3	CR.NAVARRA/PAG 20080418	18/04/2008	C	9.641,48
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153066J7	CR.NAVARRA/PAG 20080625	25/06/2008	C	9.630,56
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153066K5	CR.NAVARRA/PAG 20080102	02/01/2008	C	9.901,68
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153066M1	CR.NAVARRA/PAG 20080716	16/07/2008	C	9.567,77
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153066S8	CR.NAVARRA/PAG 20080908	08/09/2008	C	9.538,40
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153066T6	CR.NAVARRA/PAG 20080910	10/09/2008	C	9.602,60
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153066U4	CR.NAVARRA/PAG 20080917	17/09/2008	C	9.554,58
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153066V2	CR.NAVARRA/PAG 20081001	01/10/2008	C	9.555,00
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153066Y6	CR.NAVARRA/PAG 20081015	15/10/2008	C	9.556,83
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153066Z3	CR.NAVARRA/PAG 20080423	23/04/2008	C	9.771,58
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153067A4	CR.NAVARRA/PAG 20081112	12/11/2008	C	9.570,51
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153067B2	CR.NAVARRA/PAG 20081119	19/11/2008	C	9.556,96
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153067D8	CR.NAVARRA/PAG 20081210	10/12/2008	C	9.541,11
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153067E6	CR.NAVARRA/PAG 20081204	04/12/2008	C	9.546,74
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153067G1	CR.NAVARRA/PAG 20081217	17/12/2008	C	9.533,07
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515316026	RURALCAJA/PAG 20080130	02/01/2008	C	9.881,69
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515316042	RURALCAJA/PAG 20080130	30/01/2008	C	9.917,26
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515316091	RURALCAJA/PAG 20080326	26/03/2008	C	9.764,77
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515316109	RURALCAJA/PAG 20080924	24/09/2008	C	9.543,62
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515316117	RURALCAJA/PAG 20080917	17/09/2008	C	9.555,03
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515316125	RURALCAJA/PAG 20081001	01/10/2008	C	9.543,38
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515316133	RURALCAJA/PAG 20081019	09/10/2008	C	9.879,33
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515316158	RURALCAJA/PAG 20081022	22/10/2008	C	9.557,92
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515316166	RURALCAJA/PAG 20080507	07/05/2008	C	9.776,82
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515316174	RURALCAJA/PAG 20080213	13/02/2008	C	9.911,44
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515316182	RURALCAJA/PAG 20081119	19/11/2008	C	9.554,80
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515316208	RURALCAJA/PAG 20080625	25/06/2008	C	9.732,84
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515316216	RURALCAJA/PAG 20081203	03/12/2008	C	9.547,10
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515316224	RURALCAJA/PAG 20080618	18/06/2008	C	9.764,81
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515316232	RURALCAJA/PAG 20080319	19/03/2008	C	9.879,12
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515316240	RURALCAJA/PAG 20081217	17/12/2008	C	9.540,84
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE	ES0514601204	CAJAMAR/PAG 20080108	08/01/2008	C	961,34
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE	ES0514601238	CAJAMAR/PAG 20080130	30/01/2008	C	995,83
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE	ES0514601246	CAJAMAR/PAG 20080215	15/02/2008	C	988,77
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE	ES0514601261	CAJAMAR/PAG 20080228	28/02/2008	C	976,99
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE	ES0514601287	CAJAMAR/PAG 20080314	14/03/2008	C	976,77
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE	ES0514601311	CAJAMAR/PAG 20080430	30/04/2008	C	976,84
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE	ES0514601337	CAJAMAR/PAG 20080701	01/07/2008	C	958,65
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE	ES0514601378	CAJAMAR/PAG 20080829	29/08/2008	C	954,00
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE	ES0514601394	CAJAMAR/PAG 20080910	10/09/2008	C	954,48
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO	ES0567960747	CORP.ANDINA/PAG 20080318	18/03/2008	C	97.648,26
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO	ES0567960754	CORP.ANDINA/PAG 20081024	24/10/2008	C	95.506,36
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO	ES0567960762	CORP.ANDINA/PAG 20080527	27/05/2008	C	97.674,44
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910A8	ELE.CAP/PAG 20080430	30/04/2008	C	48.891,87
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910B6	ELE.CAP/PAG 20081029	29/10/2008	C	47.818,18
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910C4	ELE.CAP/PAG 20080507	07/05/2008	C	48.868,57
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910D2	ELE.CAP/PAG 20080213	13/02/2008	C	49.424,14

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910E0	ELE.CAP/PAG 20080514	14/05/2008	C	48.876,11
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910F7	ELE.CAP/PAG 20081112	12/11/2008	C	47.803,84
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910G5	ELE.CAP/PAG 20080220	20/02/2008	C	49.428,36
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910H3	ELE.CAP/PAG 20080227	27/02/2008	C	49.411,22
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910I1	ELE.CAP/PAG 20081126	26/11/2008	C	47.775,24
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910J9	ELE.CAP/PAG 20080730	30/07/2008	C	48.486,13
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910K7	ELE.CAP/PAG 20081203	03/12/2008	C	47.728,92
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910L5	ELE.CAP/PAG 20081210	10/12/2008	C	47.680,80
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991555	ELE.CAP/PAG 20080116	16/01/2008	C	985,11
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991589	ELE.CAP/PAG 20080312	12/03/2008	C	48.921,92
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991621	ELE.CAP/PAG 20080326	26/03/2008	C	48.749,17
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991639	ELE.CAP/PAG 20080402	02/04/2008	C	48.682,61
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991662	ELE.CAP/PAG 20080123	23/01/2008	C	49.440,26
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991670	ELE.CAP/PAG 20080423	23/04/2008	C	48.802,60
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991696	ELE.CAP/PAG 20080206	06/02/2008	C	49.149,19
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991738	ELE.CAP/PAG 20080521	21/05/2008	C	48.258,63
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991753	ELE.CAP/PAG 20080528	28/05/2008	C	48.626,15
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991761	ELE.CAP/PAG 20080611	11/06/2008	C	48.570,01
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES053099179	ELE.CAP/PAG 20080702	02/07/2008	C	47.838,81
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991803	ELE.CAP/PAG 20080109	09/01/2008	C	49.691,72
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991837	ELE.CAP/PAG 20080716	16/07/2008	C	47.788,42
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES053099184	ELE.CAP/PAG 20080903	03/09/2008	C	47.693,07
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991860	ELE.CAP/PAG 20080305	05/03/2008	C	49.266,00
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES053099187	ELE.CAP/PAG 20080910	10/09/2008	C	47.731,53
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991894	ELE.CAP/PAG 20080917	17/09/2008	C	47.770,13
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991902	ELE.CAP/PAG 20080924	24/09/2008	C	47.882,67
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991910	ELE.CAP/PAG 20080102	02/01/2008	C	49.403,95
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991928	ELE.CAP/PAG 20081001	01/10/2008	C	47.728,44
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991936	ELE.CAP/PAG 20080409	09/04/2008	C	48.829,55
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991944	ELE.CAP/PAG 20080116	16/01/2008	C	49.407,17
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991951	ELE.CAP/PAG 20080416	16/04/2008	C	48.851,42
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991969	ELE.CAP/PAG 20081008	08/10/2008	C	47.771,45
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991977	ELE.CAP/PAG 20081015	15/10/2008	C	47.781,72
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991985	ELE.CAP/PAG 20081022	22/10/2008	C	47.923,62
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991993	ELE.CAP/PAG 20080130	30/01/2008	C	49.477,93
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250C4	HIDROCANTABRICO/PAG 20080515	15/05/2008	C	965,48
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250F7	HIDROCANTABRICO/PAG 20080530	30/05/2008	C	967,59
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250H3	HIDROCANTABRICO/PAG 20080530	30/05/2008	C	191.460,83
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250I1	HIDROCANTABRICO/PAG 20080616	16/06/2008	C	974,83
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250J9	HIDROCANTABRICO/PAG 20080424	24/04/2008	C	192.599,78
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250K7	HIDROCANTABRICO/PAG 20080618	18/06/2008	C	191.242,98
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250L5	HIDROCANTABRICO/PAG 20081218	18/12/2008	C	190.564,65
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250M3	HIDROCANTABRICO/PAG 20080630	30/06/2008	C	966,31
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250P6	HIDROCANTABRICO/PAG 20090204	04/02/2009	C	189.310,50
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250Q4	HIDROCANTABRICO/PAG 20080218	18/02/2008	C	979,16
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250R2	HIDROCANTABRICO/PAG 20080818	18/08/2008	C	959,04
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250S0	HIDROCANTABRICO/PAG 20080228	28/02/2008	C	983,23
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250T8	HIDROCANTABRICO/PAG 20080829	29/08/2008	C	954,89
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250U6	HIDROCANTABRICO/PAG 20080317	17/03/2008	C	984,28
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250V4	HIDROCANTABRICO/PAG 20080331	31/03/2008	C	976,52
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250W2	HIDROCANTABRICO/PAG 20080930	30/09/2008	C	954,29
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250X0	HIDROCANTABRICO/PAG 20081015	15/10/2008	C	954,76
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250Y8	HIDROCANTABRICO/PAG 20080424	24/04/2008	C	977,56
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060250Z5	HIDROCANTABRICO/PAG 20081024	24/10/2008	C	955,60
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060251A6	HIDROCANTABRICO/PAG 20080812	12/08/2008	C	193.279,34
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060251B4	HIDROCANTABRICO/PAG 20081117	17/11/2008	C	955,63
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060251C2	HIDROCANTABRICO/PAG 20081128	28/11/2008	C	955,31
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060251D0	HIDROCANTABRICO/PAG 20081215	15/12/2008	C	953,11
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025875	HIDROCANTABRICO/PAG 20080115	15/01/2008	C	986,97
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025891	HIDROCANTABRICO/PAG 20080131	31/01/2008	C	989,93
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025909	HIDROCANTABRICO/PAG 20080131	31/01/2008	C	192.856,73
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025925	HIDROCANTABRICO/PAG 20080215	15/02/2008	C	988,48
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025941	HIDROCANTABRICO/PAG 20080415	15/04/2008	C	959,12
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025990	HIDROCANTABRICO/PAG 20080430	30/04/2008	C	973,33
IBERDROLA, S.A.	ES0544580BA2	IBE/PAG 20080221	21/02/2008	C	964,15
IBERDROLA, S.A.	ES0544580BD6	IBE/PAG 20080313	13/03/2008	C	976,37
IBERDROLA, S.A.	ES0544580BE4	IBE/PAG 20080911	11/09/2008	C	954,61
IBERDROLA, S.A.	ES0544580BF1	IBE/PAG 20080403	03/04/2008	C	959,44
IBERDROLA, S.A.	ES0544580BG9	IBE/PAG 20080417	17/04/2008	C	972,59
IBERDROLA, S.A.	ES0544580BH7	IBE/PAG 20080124	24/01/2008	C	988,22
IBERDROLA, S.A.	ES0544580BI5	IBE/PAG 20080424	24/04/2008	C	959,34
IBERDROLA, S.A.	ES0544580BK1	IBE/PAG 20080430	30/04/2008	C	966,22
IBERDROLA, S.A.	ES0544580BM7	IBE/PAG 20080508	08/05/2008	C	977,07
IBERDROLA, S.A.	ES0544580BN5	IBE/PAG 20081106	06/11/2008	C	956,03
IBERDROLA, S.A.	ES0544580BP0	IBE/PAG 20080515	15/05/2008	C	976,39
IBERDROLA, S.A.	ES0544580BQ8	IBE/PAG 20081113	13/11/2008	C	956,02
IBERDROLA, S.A.	ES0544580BT2	IBE/PAG 20080529	29/05/2008	C	975,04
IBERDROLA, S.A.	ES0544580BW6	IBE/PAG 20080605	05/06/2008	C	966,34
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CA0	IBE/PAG 20080612	12/06/2008	C	974,19
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CD4	IBE/PAG 20080710	10/07/2008	C	956,36
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CE2	IBE/PAG 20080717	17/07/2008	C	966,01
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CG7	IBE/PAG 20080807	07/08/2008	C	958,82
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CH5	IBE/PAG 20080214	14/02/2008	C	979,86
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CI3	IBE/PAG 20080814	14/08/2008	C	959,59
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CJ1	IBE/PAG 20080821	21/08/2008	C	964,68
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CK9	IBE/PAG 20080228	28/02/2008	C	977,19
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CL7	IBE/PAG 20080828	28/08/2008	C	954,52
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CM5	IBE/PAG 20080306	06/03/2008	C	977,24
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CN3	IBE/PAG 20080904	04/09/2008	C	953,85
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CO1	IBE/PAG 20080320	20/03/2008	C	976,61
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CP8	IBE/PAG 20080918	18/09/2008	C	955,02
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CQ6	IBE/PAG 20080327	27/03/2008	C	981,96
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CS2	IBE/PAG 20080925	25/09/2008	C	955,38
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CT0	IBE/PAG 20081016	16/10/2008	C	956,05
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CU8	IBE/PAG 20081023	23/10/2008	C	956,11
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CV6	IBE/PAG 20080522	22/05/2008	C	977,33
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CW4	IBE/PAG 20081120	20/11/2008	C	955,69
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CX2	IBE/PAG 20081127	27/11/2008	C	955,50
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CY0	IBE/PAG 20080731	31/07/2008	C	969,53
IBERDROLA, S.A.	ES0544580CZ7	IBE/PAG 20081203	03/12/2008	C	954,58
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DA8	IBE/PAG 20081204	04/12/2008	C	954,40

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DB6	IBE/PAG 20081211	11/12/2008	C	953,57
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DC4	IBE/PAG 20081218	18/12/2008	C	953,54
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DD2	IBE/PAG 20080619	19/06/2008	C	976,43
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176172L2	LICO.LEASING/PAG 20080110	10/01/2008	C	98.781,49
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176172O6	LICO.LEASING/PAG 20080121	21/01/2008	C	98.620,28
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176172S7	LICO.LEASING/PAG 20080228	28/02/2008	C	98.607,80
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176172T5	LICO.LEASING/PAG 20080307	07/03/2008	C	97.640,40
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176172W9	LICO.LEASING/PAG 20080402	02/04/2008	C	97.706,57
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176172X7	LICO.LEASING/PAG 20080410	10/04/2008	C	97.615,98
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173C9	LICO.LEASING/PAG 20080612	12/06/2008	C	97.586,99
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173E5	LICO.LEASING/PAG 20080128	28/01/2008	C	98.356,23
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173F2	LICO.LEASING/PAG 20080304	04/03/2008	C	97.657,68
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173G0	LICO.LEASING/PAG 20080904	04/09/2008	C	95.373,42
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173H8	LICO.LEASING/PAG 20080312	12/03/2008	C	97.658,49
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173J6	LICO.LEASING/PAG 20080910	10/09/2008	C	95.475,25
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173J4	LICO.LEASING/PAG 20080915	15/09/2008	C	95.454,93
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173K2	LICO.LEASING/PAG 20080325	25/03/2008	C	97.720,89
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173L0	LICO.LEASING/PAG 20081001	01/10/2008	C	95.346,22
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173M8	LICO.LEASING/PAG 20080417	17/04/2008	C	97.682,38
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173N6	LICO.LEASING/PAG 20081015	15/10/2008	C	95.459,68
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173O4	LICO.LEASING/PAG 20080430	30/04/2008	C	97.735,88
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173P1	LICO.LEASING/PAG 20080523	23/05/2008	C	97.708,50
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173Q9	LICO.LEASING/PAG 20081201	01/12/2008	C	95.455,54
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173R7	LICO.LEASING/PAG 20080530	30/05/2008	C	97.686,99
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173S5	LICO.LEASING/PAG 20080618	18/06/2008	C	97.590,90
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173T3	LICO.LEASING/PAG 20081118	18/11/2008	C	95.607,22
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE	ES05176173U1	LICO.LEASING/PAG 20081216	16/12/2008	C	95.340,14
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0517156B38	EL.MONTE/PAG 20080118	18/01/2008	C	48.040,98
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0517156B53	EL.MONTE/PAG 20080124	24/01/2008	C	48.223,82
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0517156B79	EL.MONTE/PAG 20080104	04/01/2008	C	48.232,76
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0517156B87	EL.MONTE/PAG 20080328	28/03/2008	C	47.773,21
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0517156D02	EL.MONTE/PAG 20080411	11/04/2008	C	47.952,97
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0517156D10	EL.MONTE/PAG 20080425	25/04/2008	C	47.976,08
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0517156D44	EL.MONTE/PAG 20080502	02/05/2008	C	47.939,55
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197002	CAJASOL/PAG 20080327	27/03/2008	C	48.832,57
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197010	CAJASOL/PAG 20080918	18/09/2008	C	47.798,62
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197036	CAJASOL/PAG 20080403	03/04/2008	C	48.818,18
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197051	CAJASOL/PAG 20081002	02/10/2008	C	47.715,46
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197077	CAJASOL/PAG 20080110	10/01/2008	C	49.365,86
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197085	CAJASOL/PAG 20080619	19/06/2008	C	48.818,64
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197093	CAJASOL/PAG 20080410	10/04/2008	C	48.819,21
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197119	CAJASOL/PAG 20080227	27/02/2008	C	49.079,48
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197127	CAJASOL/PAG 20081009	09/10/2008	C	47.750,93
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197143	CAJASOL/PAG 20080417	17/04/2008	C	48.852,91
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197168	CAJASOL/PAG 20080424	24/04/2008	C	48.859,64
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197176	CAJASOL/PAG 20080131	31/01/2008	C	49.411,54
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197192	CAJASOL/PAG 20081030	30/10/2008	C	47.776,60
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197200	CAJASOL/PAG 20080508	08/05/2008	C	48.826,31
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197218	CAJASOL/PAG 20081106	06/11/2008	C	47.796,24
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197234	CAJASOL/PAG 20080515	15/05/2008	C	48.887,83
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197267	CAJASOL/PAG 20080522	22/05/2008	C	48.857,65
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197291	CAJASOL/PAG 20080529	29/05/2008	C	48.853,33
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197309	CAJASOL/PAG 20080605	05/06/2008	C	48.842,27
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197317	CAJASOL/PAG 20081211	11/12/2008	C	47.656,31
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197325	CAJASOL/PAG 20081204	04/12/2008	C	47.734,96
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANI	ES0558197333	CAJASOL/PAG 20080214	14/02/2008	C	49.612,61
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648721F8)	ES05648721F8	UNICAJA/PAG 20080305	05/03/2008	C	97.614,79
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648721G6)	ES05648721G6	UNICAJA/PAG 20080320	20/03/2008	C	97.786,08
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648721I2)	ES05648721I2	UNICAJA/PAG 20080104	04/01/2008	C	98.519,72
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648721J0)	ES05648721J0	UNICAJA/PAG 20080121	21/01/2008	C	96.776,38
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648721K8)	ES05648721K8	UNICAJA/PAG 20080205	05/02/2008	C	98.833,08
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648721L6)	ES05648721L6	UNICAJA/PAG 20080220	20/02/2008	C	97.928,38
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648721M4)	ES05648721M4	UNICAJA/PAG 20080404	04/04/2008	C	97.491,66
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648721N2)	ES05648721N2	UNICAJA/PAG 20080421	21/04/2008	C	97.666,19
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648721O0)	ES05648721O0	UNICAJA/PAG 20080505	05/05/2008	C	97.980,94
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648721Q5)	ES05648721Q5	UNICAJA/PAG 20080605	05/06/2008	C	95.924,76
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648721R3)	ES05648721R3	UNICAJA/PAG 20080620	20/06/2008	C	97.594,19
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648721T9)	ES05648721T9	UNICAJA/PAG 20080721	21/07/2008	C	95.819,20
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648721X1)	ES05648721X1	UNICAJA/PAG 20080919	19/09/2008	C	95.710,94
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648721Y9)	ES05648721Y9	UNICAJA/PAG 20081006	06/10/2008	C	95.772,16
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648721Z6)	ES05648721Z6	UNICAJA/PAG 20081219	19/12/2008	C	95.252,18
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648722A7)	ES05648722A7	UNICAJA/PAG 20081020	20/10/2008	C	95.869,72
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648722B5)	ES05648722B5	UNICAJA/PAG 20081105	05/11/2008	C	95.588,98
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, (ES05648722D1)	ES05648722D1	UNICAJA/PAG 20081205	05/12/2008	C	95.455,41
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828708Q4	SVV/PAG 20080109	09/01/2008	C	982,90
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828708R2	SVV/PAG 20080123	23/01/2008	C	964,94
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828708T8	SVV/PAG 20080206	06/02/2008	C	978,91
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828708U6	SVV/PAG 20080220	20/02/2008	C	981,24
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828708X0	SVV/PAG 20080312	12/03/2008	C	981,93
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828709C2	SVV/PAG 20080507	07/05/2008	C	959,97
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828709E8	SVV/PAG 20080521	21/05/2008	C	959,56
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828709F5	SVV/PAG 20080611	11/06/2008	C	969,13
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828709H1	SVV/PAG 20080625	25/06/2008	C	957,11
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828709I9	SVV/PAG 20080709	09/07/2008	C	957,14
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828709J7	SVV/PAG 20080723	23/07/2008	C	957,37
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828709L3	SVV/PAG 20080806	06/08/2008	C	958,03
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828709M1	SVV/PAG 20080820	20/08/2008	C	960,28
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828709N9	SVV/PAG 20080910	10/09/2008	C	954,32
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AA2	SAN.CONS.FIN/PAG 20081031	31/10/2008	C	956,27
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AB0	SAN.CONS.FIN/PAG 20091218	18/12/2009	C	910,15
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AC8	SAN.CONS.FIN/PAG 20081128	28/11/2008	C	954,82
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495P49	SAN.CONS.FIN/PAG 20080104	04/01/2008	C	992,59
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495P56	SAN.CONS.FIN/PAG 20080111	11/01/2008	C	993,95
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495P64	SAN.CONS.FIN/PAG 20080118	18/01/2008	C	994,72
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495P72	SAN.CONS.FIN/PAG 20080125	25/01/2008	C	991,86
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495P80	SAN.CONS.FIN/PAG 20080208	08/02/2008	C	988,33
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495P98	SAN.CONS.FIN/PAG 20080215	15/02/2008	C	970,73
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Q14	SAN.CONS.FIN/PAG 20080222	22/02/2008	C	976,47
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Q30	SAN.CONS.FIN/PAG 20080229	29/02/2008	C	988,41
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Q55	SAN.CONS.FIN/PAG 20080307	07/03/2008	C	976,56
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Q71	SAN.CONS.FIN/PAG 20080314	14/03/2008	C	971,59
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495R21	SAN.CONS.FIN/PAG 20080328	28/03/2008	C	985,10

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495R47	SAN.CONS.FIN/PAG 20080404	04/04/2008	C	976,13
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495R54	SAN.CONS.FIN/PAG 20080411	11/04/2008	C	974,07
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495R88	SAN.CONS.FIN/PAG 20080418	18/04/2008	C	971,87
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495S04	SAN.CONS.FIN/PAG 20080425	25/04/2008	C	970,03
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495S53	SAN.CONS.FIN/PAG 20080516	16/05/2008	C	962,38
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495S79	SAN.CONS.FIN/PAG 20080523	23/05/2008	C	977,05
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495S95	SAN.CONS.FIN/PAG 20080530	30/05/2008	C	976,92
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495T11	SAN.CONS.FIN/PAG 20080606	06/06/2008	C	966,16
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495T29	SAN.CONS.FIN/PAG 20080613	13/06/2008	C	974,24
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495T45	SAN.CONS.FIN/PAG 20080620	20/06/2008	C	975,22
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495T86	SAN.CONS.FIN/PAG 20080704	04/07/2008	C	971,76
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495U00	SAN.CONS.FIN/PAG 20080711	11/07/2008	C	955,69
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495U18	SAN.CONS.FIN/PAG 20080718	18/07/2008	C	965,47
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495U26	SAN.CONS.FIN/PAG 20080725	25/07/2008	C	957,49
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495U34	SAN.CONS.FIN/PAG 20080801	01/08/2008	C	965,51
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495U42	SAN.CONS.FIN/PAG 20080808	08/08/2008	C	958,90
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495U59	SAN.CONS.FIN/PAG 20080822	22/08/2008	C	954,87
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495U67	SAN.CONS.FIN/PAG 20080829	29/08/2008	C	957,36
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495U75	SAN.CONS.FIN/PAG 20080912	12/09/2008	C	955,87
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495U83	SAN.CONS.FIN/PAG 20080919	19/09/2008	C	954,11
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495U91	SAN.CONS.FIN/PAG 20080926	26/09/2008	C	955,35
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495V17	SAN.CONS.FIN/PAG 20081024	24/10/2008	C	956,63
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495V58	SAN.CONS.FIN/PAG 20080509	09/05/2008	C	961,96
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495V66	SAN.CONS.FIN/PAG 20081212	12/12/2008	C	953,10
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495V74	SAN.CONS.FIN/PAG 20081219	19/12/2008	C	954,29
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495W08	SAN.CONS.FIN/PAG 20080627	27/06/2008	C	966,80
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495W24	SAN.CONS.FIN/PAG 20090206	06/02/2009	C	935,07
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495W40	SAN.CONS.FIN/PAG 20080201	01/02/2008	C	990,24
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495X23	SAN.CONS.FIN/PAG 20081017	17/10/2008	C	955,45
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495X31	SAN.CONS.FIN/PAG 20090508	08/05/2009	C	918,85
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495X64	SAN.CONS.FIN/PAG 20081121	21/11/2008	C	955,76
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495X72	SAN.CONS.FIN/PAG 20081205	05/12/2008	C	954,32
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Y97	SAN.CONS.FIN/PAG 20090904	04/09/2009	C	909,08
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Z39	SAN.CONS.FIN/PAG 20080905	05/09/2008	C	956,32
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Z47	SAN.CONS.FIN/PAG 20091023	23/10/2009	C	910,48
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Z62	SAN.CONS.FIN/PAG 20081003	03/10/2008	C	959,78
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CK6	TEF/PAG 20080131	31/01/2008	C	98.267,65
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CY7	TEF/PAG 20080110	10/01/2008	C	99.257,79
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DB3	TEF/PAG 20080313	13/03/2008	C	95.375,48
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DE7	TEF/PAG 20080110	10/01/2008	C	979,92
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DF4	TEF/PAG 20080124	24/01/2008	C	964,17
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DG2	TEF/PAG 20080228	28/02/2008	C	97.862,22
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DH0	TEF/PAG 20080207	07/02/2008	C	984,43
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DJ6	TEF/PAG 20080221	21/02/2008	C	971,97
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DK4	TEF/PAG 20080306	06/03/2008	C	964,87
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DL2	TEF/PAG 20080313	13/03/2008	C	973,72
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DM0	TEF/PAG 20081002	02/10/2008	C	95.418,03
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DO6	TEF/PAG 20080403	03/04/2008	C	961,43
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DP3	TEF/PAG 20080424	24/04/2008	C	959,19
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DQ1	TEF/PAG 20080508	08/05/2008	C	971,61
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DR9	TEF/PAG 20080522	22/05/2008	C	975,28
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DS7	TEF/PAG 20080612	12/06/2008	C	957,90
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DT5	TEF/PAG 20080626	26/06/2008	C	959,31
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DV1	TEF/PAG 20080710	10/07/2008	C	964,33
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DW9	TEF/PAG 20080724	24/07/2008	C	956,89
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DX7	TEF/PAG 20080228	28/02/2008	C	976,91
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DY5	TEF/PAG 20080828	28/08/2008	C	954,16
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DZ2	TEF/PAG 20080828	28/08/2008	C	95.404,37
TELEFONICA, S.A.	ES0578430EA3	TEF/PAG 20080911	11/09/2008	C	954,68
TELEFONICA, S.A.	ES0578430EB1	TEF/PAG 20080925	25/09/2008	C	954,64
TELEFONICA, S.A.	ES0578430EC9	TEF/PAG 20081009	09/10/2008	C	954,80
TELEFONICA, S.A.	ES0578430ED7	TEF/PAG 20081023	23/10/2008	C	955,97
TELEFONICA, S.A.	ES0578430EE5	TEF/PAG 20081030	30/10/2008	C	95.523,86
TELEFONICA, S.A.	ES0578430EF2	TEF/PAG 20081106	06/11/2008	C	95.590,48
TELEFONICA, S.A.	ES0578430EG0	TEF/PAG 20081113	13/11/2008	C	95.565,55
TELEFONICA, S.A.	ES0578430EH8	TEF/PAG 20081120	20/11/2008	C	955,55
TELEFONICA, S.A.	ES0578430EI6	TEF/PAG 20080605	05/06/2008	C	976,67
TELEFONICA, S.A.	ES0578430EK2	TEF/PAG 20081211	11/12/2008	C	95.302,82
TELEFONICA, S.A.	ES0578430EL0	TEF/PAG 20081218	18/12/2008	C	955,60
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FJ3	UNF/PAG 20081027	27/10/2008	C	946,48
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FN5	UNF/PAG 20080305	05/03/2008	C	974,74
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FP0	UNF/PAG 20080625	25/06/2008	C	957,28
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FQ8	UNF/PAG 20080107	07/01/2008	C	987,63
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FU0	UNF/PAG 20080115	15/01/2008	C	985,91
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FW6	UNF/PAG 20080818	18/08/2008	C	941,33
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FX4	UNF/PAG 20080125	25/01/2008	C	984,35
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FZ9	UNF/PAG 20080205	05/02/2008	C	967,89
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GD4	UNF/PAG 20080215	15/02/2008	C	969,43
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GG7	UNF/PAG 20080225	25/02/2008	C	976,43
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GI3	UNF/PAG 20080407	07/04/2008	C	972,25
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GJ1	UNF/PAG 20080516	16/05/2008	C	958,04
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GK9	UNF/PAG 20081117	17/11/2008	C	937,83
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GL7	UNF/PAG 20080605	05/06/2008	C	957,11
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GP8	UNF/PAG 20080724	24/07/2008	C	956,36
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GQ6	UNF/PAG 20080825	25/08/2008	C	958,65
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GR4	UNF/PAG 20080905	05/09/2008	C	953,63
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GS2	UNF/PAG 20080325	25/03/2008	C	978,25
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GT0	UNF/PAG 20080925	25/09/2008	C	954,39
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GU8	UNF/PAG 20080317	17/03/2008	C	983,52
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GV6	UNF/PAG 20081006	06/10/2008	C	954,69
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GW4	UNF/PAG 20080415	15/04/2008	C	976,93
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GX2	UNF/PAG 20081015	15/10/2008	C	957,77
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GY0	UNF/PAG 20080425	25/04/2008	C	977,81
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GZ7	UNF/PAG 20080505	05/05/2008	C	977,06
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HB6	UNF/PAG 20080616	16/06/2008	C	975,66
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HC4	UNF/PAG 20081205	05/12/2008	C	954,60
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HD2	UNF/PAG 20090605	05/06/2009	C	933,19
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HE0	UNF/PAG 20090625	25/06/2009	C	931,70

**RENTA FIJA****PARTICIPACIONES PREFERENTES**

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCAJA EUROCAPITAL FINANCE	KYG0727Q1073	BANCAJA.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	600,00
BANCAJA EUROCAPITAL FINANCE	KYG0727Q1156	BANCAJA.FIN/VAR NACU AMTB PPR B		V	599,99
BANESTO PREFERENTES, S.A.	ES0113772000	BTO.PREF/VAR NACU AMTB PPR I		V	24,88
BANKINTER EMISIONES, S.A.	ES0113549002	BKT.EM/VAR NACU AMTB PPR I		V	48,42
BANKINTER EMISIONES, S.A.	ES0113549028	BKT.EM/VAR NACU AMTB PPR II		V	48,37
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224001	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	100,42
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224027	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR B		V	100,45
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224043	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR C		V	100,45
BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA INTERNATIONAL LTD	KYG090001119	BBVA.INTL/VAR NACU AMTB PPR F		V	100,44
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL	KYG1280W1015	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.004,89
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL	KYG717151099	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.005,10
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL	KYG717151172	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.004,24
BVA PREFERENTES, S.A.	ES0115006001	BVA.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	50.539,29
CAIXA CATALUNYA PREFERENTS, S.A.	KYG175431025	CA.CAT.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.005,74
CAIXA CATALUNYA PREFERENTS, S.A.	KYG175431108	CA.CAT.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.005,80
CAIXA DE MANLLEU PREFERENTS, S.A.	ES0115328009	CA.MANLLEU.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	500,89
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0113249009	CA.GIRONA/VAR NACU AMTB PPR		V	50.007,72
CAIXA GALICIA PREFERENTES, S.A., SOCIEDAD UNIPER	ES0112805009	CA.GALICIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	582,41
CAIXA LAIETANA SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFE	ES0113251005	LAIETANA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	50.136,90
CAIXA LAIETANA SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFE	KYG1754W1087	LAIETANA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.004,51
CAIXA MANRESA PREFERENTS, S.A.	ES0115211007	CA.MANRESA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	100,22
CAIXA ONTINYENT PREFERENTS, S.A.	ES0157083025	ONTINYENT.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	50.182,23
CAIXA PENEDES CAPITAL, S.A. SOCIEDAD UNIPERSONA	KYG1755N1079	CA.PENEDES.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.004,28
CAIXA PREFERENCE, S.A.	KYG175471039	CAIXA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.004,95
CAIXA PREFERENCE, S.A.	KYG175471112	CAIXA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.005,37
CAIXA TERRASSA, SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREI	KYG175491094	TERRASSA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.005,01
CAIXANOVA EMISIONES, S.A.	ES0169075001	CAIXANOVA.EM/VAR NACU AMTB PPR A		V	60,19
CAIXANOVA EMISIONES, S.A.	ES0169075027	CAIXANOVA.EM/VAR NACU AMTB PPR B		V	50.010,71
CAIXASABADELL PREFERENTS, S.A.	ES0101339002	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.005,33
CAIXASABADELL PREFERENTS, S.A.	ES0101339028	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	50.483,89
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA, PAR	ES0157085004	GUADALAJAR.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	100.441,66
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0114959002	CA.SEGOVIA/VAR NACU AMTB PPR		V	1.002,17
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZ	ES0114954003	IBERCAJA/VAR NACU AMTB PPR 1º		V	50.647,59
CAJA DE AVILA PREFERENTES, S.A.	ES0122707005	CA.AVILA.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	1.002,42
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SOCIEDAD DE PARTIC	ES0115372007	CA.ESPAÑA.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.000,09
CAJA MADRID FINANCE PREFERRED	ES0115373005	CA.MAD.FIN.PREF/VAR NACU AMTB PPR I		V	97,36
CAJA RIOJA PREFERENTES, S.A.	ES0113698007	CA.RIOJA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	504,86
CAJA SAN FERNANDO PREFERENCE LIMITED	KYG1755U1195	CA.SAN.FER.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	302,25
CAJAMURCIA FINANCE, S.A.	KYG175552051	CAJAMURCIA.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	502,45
CAJAMURCIA PREFERENTES, S.A. UNIPERSONAL	ES0114818000	CAJAMURCIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	504,73
CAJAMURCIA PREFERENTES, S.A. UNIPERSONAL	ES0114818026	CAJAMURCIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	50.201,46
CAJAMURCIA PREFERENTES, S.A. UNIPERSONAL	ES0114818042	CAJAMURCIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR D		V	50.000,00
CAJASUR SOCIEDAD DE PARTICIPACIONES PREFEREN	KYG1755M1096	CAJASUR.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	602,99
CAM CAPITAL, S.A.	KYG1793R1020	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	603,07
CAM CAPITAL, S.A.	KYG1793R1103	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	603,02
CANTABRIA CAPITAL LIMITED	KYG1825G1082	CANTABRIA.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	603,14
CANTABRIA PREFERENTES, S.A. SOCIEDAD UNIPERSON	ES0182834004	CANTABRIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR I		V	1.005,07
CANTABRIA PREFERENTES, S.A. SOCIEDAD UNIPERSON	ES0182834020	CANTABRIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR 2		V	1.005,24
CCM DE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A., SOCIE	ES0116977002	CCM.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	602,89
CCM PREFERENCE LIMITED	KYG1984E1180	CCM.PREF.LTD/VAR NACU AMTB PPR A		V	603,03
EL MONTE CAPITAL, S.A.U.	KYG3014M1024	MONTE.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	502,66
EL MONTE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A	ES0128469006	EL.MONTE.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.005,57
ENDESA CAPITAL FINANCE, LLC.	USU291871080	ELE.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR		V	24,16
GALLEGO PREFERENTES, S.A.U.	ES0170234001	GALLEGO.PREF/VAR NACU AMTB PPR 1		V	50.188,80
GUIPUZCOANO CAPITAL, S.A.	ES0143561001	GUI.CAP/VAR NACU AMTB PPR I		V	99,70
LA CAJA DE CANARIAS PREFERENTES, S.A.	ES0156844005	LA.CAJA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	502,08
REPSOL INTERNATIONAL CAPITAL LIMITEC	KYG7513K1379	REP.INTL.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.003,97
REPSOL INTERNATIONAL CAPITAL LIMITEC	KYG7513K1452	REP.INTL.CAP/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.004,41
SA NOSTRA SOCIEDAD DE PARTICIPACIONES PREFERE	KYG7803W1069	SA.NOSTRA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.003,42
SABADELL INTERNATIONAL EQUITY, LTD	KYG773751063	SAB.INTL.EQ/VAR NACU AMTB PPR A		V	502,23
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	100,78
SOS CUETARA PREFERENTES, S.A.U.	ES0130124003	SOS.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	49.983,57
TELEFONICA FINANCE USA, L.L.C.	USU87942AA33	TEF.FIN.USA/VAR NACU AMTB PPR		V	1.004,61
UNION FENOSA FINANCIAL SERVICES USA, LLC.	USU90716AA64	UNF.FINL.USA/VAR NACU AMTB PPR		V	24,43

**RENTA VARIABLE**

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ABENGOA, S.A.	ES0105200416	ABG/AC 0,25			25,82
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0111845014	ABE/AC 3,00			22,73
ACCIONA, S.A.	ES0125220311	ANA/AC 1,00			217,34
ACERINOX, S.A.	ES0132105018	ACX/AC 0,25			19,18
ACS, ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS, S	ES0167050915	ACS/AC 0,50			41,34
ACTUACIONES ACTIVIDADES E INVERSIONES INMOBILI	ES0106585013	AISA/AC 6,00			9,20
ADOLFO DOMINGUEZ, S.A.	ES0106000013	ADZ/AC 0,60			29,56
AGRICOLA DE FRUTOS SECOS, S.A.	ES0106325014	AGROFUSE/AC 3,01			7,73
AGUAS DE VALENCIA, S.A.	ES0107250013	AGUAS.VAL/AC 3,01			106,13
ALFA S.A. DE C.V.	MXP000511016	AC. ALFA S/A			46,18
ALTADIS, S.A.	ES0177040013	ALT/AC 0,10			49,43
AMCI HABITAT, S.A.	ES0109196313	AMCI/AC 3,00			10,65
AMERICA MOVIL, S.A. DE C.V.	MXP001691213	AC. AMERICA MOVIL. S/L			43,24
AMPER, S.A.	ES0109260531	AMP/AC 1,00			11,65
ANTENA 3 DE TELEVISION, S.A.	ES0109427734	A3TV/AC 0,75			11,71
ARACRUZ CELULOSE, S.A.	BRARCZACNPNB3	AC. ARACRUZ CELULOSE. PREF. S/B			5,06
ARCELOR MITTAL, S.A.	LU0323134006	AC. ARCELORMITTAL			50,77
ASTROC MEDITERRANEO, S.A.	ES0110944016	AST/AC 0,20			8,73
AVANZIT, S.A.	ES0172708317	AVZ/AC 0,50			5,26
AYCO GRUPO INMOBILIARIO, S.A.	ES0152960011	AYCO.GRP.INMO/AC 3,01			18,00
AZKOYEN, S.A.	ES0112458312	AZK/AC 0,60			7,31
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0113211835	BBVA/AC 0,49			16,89
BANCO BRADESCO, S.A.	BRBBDACACNPR8	BCO BRADESCO/AC/PREF			21,65
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0113140133	AND/AC 0,75			71,84
BANCO DE CASTILLA, S.A.	ES0113243135	CAS/AC 0,60			17,30
BANCO DE CHILE, S.A.	CLP0939W1081	AC. BANCO DE CHILE			34,06
BANCO DE CREDITO BALEAR, S.A.	ES0113381133	CBL/AC 0,75			22,91
BANCO DE GALICIA, S.A.	ES0113515136	GAL/AC 0,30			19,78
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0113860A34	SAB/AC 0,125			7,26
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0113980330	BVA/AC 1,00			38,61
BANCO DE VASCONIA, S.A.	ES0113997136	VAS/AC 0,30			16,52
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0113440038	BTO/AC 0,79			13,97
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0113580C31	GUI/AC 0,25			13,64
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0113580D30	GUI/AC/PREF 0,25			14,75
BANCO PASTOR, S.A.	ES0113770434	PAS/AC 0,33			11,27
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0113790531	POP/AC 0,10			11,93
BANCO RIO DE LA PLATA, S.A.	ARBRI0010194	AC. BANCO RIO DE LA PLATA. S/B			1,75
BANCO SANTANDER PUERTO RICO	PR8028091034	AC. SANTANDER BANCORP			7,94
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0113900J37	SAN/AC 0,50			14,43
BANKINTER, S.A.	ES0113679I37	BKT/AC 0,30			11,51
BARON DE LEY, S.A.	ES0114297015	BDL/AC 0,60			49,66
BAYER AKTIENGESELLSCHAFT	DE0005752000	AC. BAYER			57,38
BBVA BANCO FRANCES, S.A.	ARP125991090	AC. BBVA BCO. FRANCES			2,06
BEFESA MEDIO AMBIENTE, S.A.	ES0114491014	BMA/AC 3,01			26,60
BODEGAS BILBAINAS, S.A.	ES0114930011	BODEGAS.BILB/AC 6,01			9,56
BODEGAS RIOJANAS, S.A.	ES0115002018	RIO/AC 0,75			9,73
BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOLES, SDAD HOLDING DE	ES0115056139	BME/AC 3,23			47,27
BRADESPAR	BRBRAPACNOR5	AC. BRADESPAR			23,35
BRADESPAR	BRBRAPACNPR2	AC. BRADESPAR -PREF.-			22,95
BRASKEM, S.A.	BRBRKMACNPA4	AC. BRASKEM -PREF.-			6,12
CAMPOFRIO ALIMENTACION, S.A.	ES0121501318	CPF/AC 1,00			11,11
CARTERA HOTELERA, S.A.	ES0162292017	CART.HOTELERA/AC 2,30			4,24
CEMENTOS MOLINS, S.A.	ES0117360117	CEMENTOS.MOLINS/AC 0,30			20,33
CEMENTOS PORTLAND VALDERRIVAS, S.A.	ES0117390411	CPL/AC 1,50			79,22
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A	BRELETACNOR6	AC. ELETROBRAS			9,93
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A	BRELETACNPNB7	AC. ELETROBRAS. PREF. S/B			9,75
CIE AUTOMOTIVE, S.A.	ES0105630315	CIE/AC 0,25			7,97
CINTRA CONCESIONES DE INFRAESTRUCTURAS DE TR	ES0118900010	CIN/AC 0,20			11,20
CLINICA BAVIERA, S.A.	ES0119037010	BAVIERA/AC 0,10			23,97
CODERE, S.A.	ES0119256115	CDR/AC 0,20			19,59
COMPANHIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	BRCMIGACNPR3	AC. CEMIG -PREF.-			14,24
COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	BRCPLEACNPNB9	AC. COPEL -PREF.-			11,00
COMPANIA D'AIGÜES DE SABADELL, S.A.	ES0107350011	AGUAS.SAB/AC B 12,02			44,10
COMPANIA DE DISTRIBUCION INTEGRAL LOGISTA, S.A	ES0160973014	LOG/AC 0,60			52,61
COMPANIA DE INVERSIONES MOBILIARIAS BARCINO, S.	ES0155972237	INV.MOB.BARCINO/AC 1,00			1,10
COMPANIA ESPAÑOLA DE PETROLEOS, S.A.	ES0132580319	CEP/AC 1,00			70,29
COMPANIA ESPAÑOLA DE VIVIENDAS EN ALQUILER, S./	ES0132955016	CEVASA/AC 6,00			198,98
COMPANIA ESPAÑOLA PARA LA FABRICACION MECANIC	ES0132110018	CELO/AC 6,65			5,45
COMPANIA LEVANTINA DE EDIFICACION Y OBRAS PUBL	ES0158300410	CLEO/AC 1,00			23,96
COMPANIA LOGISTICA DE HIDROCARBUROS CLH, S.A.	ES0110480219	CLH/AC D 1,20			59,06
COMPANIA VINICOLA DEL NORTE DE ESPAÑA, S.A.	ES0184140210	CUN/AC 0,24			17,63
CONSTRUCCIONES Y AUXILIAR DE FERROCARRILES, S	ES0121975017	CAF/AC 3,01			284,56
CORPORACION DERMOESTETICA, S.A.	ES0124204019	DERM/AC 0,10			7,88
CORPORACION FINANCIERA ALBA, S.A.	ES0117160111	ALB/AC 1,00			48,99
CORPORACION GEO, S.A. DE C.V.	MXP3142C1177	AC. GEO. S/B			2,45
CRITERIA CAIXACORP, S.A.	ES0140609019	CR/AC 1,00			5,19
DINAMIA CAPITAL PRIVADO, S.A., SCR	ES0126501131	DIN/AC 3,00			24,00
DISTRIBUCION Y SERVICIOS D&S, S.A	CL0000000522	AC. DISTRIBUCION Y SERVICIO			23,00
DOGII INTERNATIONAL FABRICS, S.A.	ES0126962010	DGI/AC 0,60			1,75
DURO FELGUERA, S.A.	ES0162600417	MDF/AC 0,50			8,70
EBRO PULEVA, S.A.	ES0112501012	EVA/AC 0,60			13,87
ELECNOR, S.A.	ES0129743219	ENO/AC 0,20			40,36
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD, S.A.	CLP3710M1090	AC. ENDESA CHILE			29,15
ENAGAS, S.A.	ES0130960018	ENG/AC 1,50			19,65
ENDESA, S.A.	ES0130670112	ELE/AC 1,20			37,02
ENERSIS, S.A.	CLP371861061	AC. ENERSIS			12,39
ERCROS, S.A.	ES0125140014	ECR/AC 0,36			0,42
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE AND SPACE COMP	NL0000235190	AC. EADS			22,51
FAES FARMA, S.A.	ES0134950F36	FAE/AC 0,10			12,14
FEDERICO PATERNINA, S.A.	ES0114989017	PAT/AC 6,01			9,14
FERSA ENERGIAS RENOVABLES, S.A.	ES0136463017	FERSA/AC 1,00			7,27
FINANZAS E INVERSIONES VALENCIANAS, S.A	ES0138152113	F&I.VALENCIANAS/AC 1,00			117,84
FLUIDRA, S.A.	ES0137650018	FDR/AC 1,00			6,20
FOMENTO DE CONSTRUCCIONES Y CONTRATAS, S.A.	ES0122060314	FCC/AC 1,00			57,58
FUNESPAÑA, S.A.	ES0140441017	FUN/AC 0,30			6,41
GAESCO HOLDING, S.A.	ES0164228019	GAESCO/AC 3,01			79,00
GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA, S.A.	ES0143416115	GAM/AC 0,17			31,66
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0116870314	GAS/AC 1,00			41,46
GENERAL DE ALQUILER DE MAQUINARIA, S.A	ES0141571119	GALQ/AC 1,00			23,79



Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
GERDAU, S.A.	BRGGBRACNPR8	AC. GERDAU -PREF.-			19,88
GESTEVISION TELECINCO, S.A.	ES0152503035	TL5/AC 0,50			18,47
GRIFOLS, S.A.	ES0171996012	GRF/AC 0,50			16,38
GRUPO CATALANA OCCIDENTE, S.A.	ES0116920333	GCO/AC 0,30			24,72
GRUPO ELEKTRA, S.A. DE C.V.	MX01EL000003	AC. GRUPO ELEKTRA			16,06
GRUPO EMPRESARIAL ENCE, S.A.	ES0130625512	ENC/AC 0,90			8,21
GRUPO FERROVIAL, S.A.	ES0162601019	FER/AC 1,00			58,33
GRUPO IUSACELL, S.A. DE C.V.	MX01CE080006	AC. IUSACELL			8,55
GRUPO MODELO, S.A. DE C.V.	MXP4833F1044	AC. GRUPO MODELO. S/C			32,45
IBERDROLA RENOVABLES, S.A.	ES0147645016	IBE.RENOVABLES/AC 0,50			5,38
IBERDROLA, S.A.	ES0144580Y14	IBE/AC 0,75			11,08
IBERIA LINEAS AEREAS DE ESPAÑA, S.A.	ES0147200036	IBL/AC 0,78			3,35
IBERPAPEL GESTION, S.A.	ES0147561015	IBG/AC 0,60			18,65
INBESOS, S.A.	ES0150480111	BES/AC 1,20			19,87
INDO INTERNACIONAL, S.A.	ES0148224118	IDO/AC 1,00			6,97
INDRA SISTEMAS, S.A.	ES0118594417	IDR/AC A 0,20			19,19
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL, S.A.	ES0148396015	ITX/AC 0,15			48,64
INDUSTRIAS DEL ACETATO DE CELULOSA, S.A.	ES0150160010	INACSA/AC 5,00			11,26
INMOBILIARIA COLONIAL, S.A.	ES0139140018	COL/AC 0,12			3,32
INMOBILIARIA DEL SUR, S.A.	ES0154653911	ISUR/AC 2,00			48,00
INMOFIBAN, S.A.	ES0154936035	INMOFIBAN/AC 1,53			92,00
INMOLEVANTE, S.A.	ES0154949012	INMOLEVANTE/AC 3,00			16,50
INVERFIATC, S.A.	ES0143419010	INVERFIATC/AC 6,00			11,11
INVERPYME, SCR, S.A.	ES01555151014	INVERPYME/AC 1,00			1,68
INYPISA INFORMES Y PROYECTOS, S.A.	ES0152768612	INY/AC 0,50			5,49
ITINERE INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0133848038	ITINERE/AC 0,49			7,52
JAZZTEL, PLC.	GB0057933615	AC. JAZZTEL			0,40
LA SEDA DE BARCELONA, S.A.	ES0175290115	SED/AC 1,00			2,14
LABORATORIOS ALMIRALL, S.A.	ES0157097017	ALMIRALL/AC 0,12			15,89
LABORATORIOS FARMACEUTICOS ROVI, S.A.	ES0157261019	ROVI/AC 0,06			9,98
LEUCAN, S.A.	ES0158275018	LEUCAN/AC 54,69			38,83
LIBERTAS 7, S.A.	ES0137998A12	LIBERTAS.7/AC 0,50			34,46
LINGOTES ESPECIALES, S.A.	ES0158480311	LGT/AC 1,00			5,66
LIWE ESPAÑOLA, S.A.	ES0158545030	LIWE.ESPAÑOLA/AC 3,15			9,70
MAPFRE, S.A.	ES0124244E34	MAP/AC 0,10			3,16
MARTINSA-FADESA, S.A.	ES0161376019	MTF/AC 0,03			17,74
MECALUX, S.A.	ES0161928116	MLX/AC 1,00			29,09
METROVACESA, S.A.	ES0154220414	MVC/AC 1,50			81,13
MIQUEL Y COSTAS & MIQUEL, S.A.	ES0164180012	MCM/AC 2,00			18,97
MONTEBALITO, S.A.	ES0116494016	MTB/AC 1,00			12,62
NATRA, S.A.	ES0165515117	NAT/AC 1,20			9,81
NATRACEUTICAL, S.A.	ES0165359011	NTC/AC 0,10			1,20
NET SERVIÇOS DE COMUNICAÇÃO, S.A.	BRNETCACNPR3	AC. NET SERVIÇOS DE COMUNICAÇÃO -PREF.-			10,21
NH HOTELES, S.A.	ES0161560018	NHH/AC 2,00			14,12
NICOLAS CORREA, S.A.	ES0166300212	NEA/AC 0,80			6,38
OBRASCON HUARTE LAIN, S.A.	ES0142090317	OHL/AC 0,60			28,26
PAPELES Y CARTONES DE EUROPA, S.A.	ES0168561019	PAC/AC 2,00			8,41
PARQUESOL INMOBILIARIA Y PROYECTOS, S.A.	ES0168632018	PSL/AC 1,00			21,54
PESCANOVA, S.A.	ES0169350016	PVA/AC 6,00			38,32
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNOR9	AC. PETROBRAS			33,02
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNPR6	AC. PETROBRAS -PREF.-			28,25
PLARREGA INVEST 2000, S.A.	ES0168626010	PLARREGA2000/AC 6,01			6,01
PRIM, S.A.	ES0170884417	PRM/AC 0,25			13,38
PROMOTORA DE INFORMACIONES, S.A.	ES0171743117	PRS/AC A 0,10			12,91
PROSEGUR, COMPAÑIA DE SEGURIDAD, S.A.	ES0175438235	PSG/AC 0,60			25,30
PULEVA BIOTECH, S.A.	ES0172233118	BIO/AC 0,24			2,34
REALIA BUSINESS, S.A.	ES0173908015	REALIA.BUS/AC 0,24			6,48
RED ELECTRICA DE ESPAÑA, S.A.	ES0173093115	REE/AC 2,00			40,05
RENO DE MEDICI, S.P.A.	IT0001178299	AC. RENO DE MEDICI. S/A			0,59
RENTA 4 SERVICIOS DE INVERSION, S.A.	ES0173358211	R4/AC 0,40			8,14
RENTA CORPORACION REAL ESTATE, S.A.	ES0173365018	REN/AC 1,00			21,45
REPSOL YPF, S.A.	ES0173516115	REP/AC 1,00			25,59
REYAL URBIS, S.A.	ES0122761010	REYAL/AC 0,01			9,39
S.A. RONSA	ES0174300014	RONSA/AC 60,10			44,33
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES0182870214	SYV/AC 1,00			29,28
SADIA, S.A.	BRSDIAACNPR1	AC. SADIA -PREF.-			4,27
SARE HOLDING, S.A., DE C.V.	MX01SA030007	AC. SARE. S/B			10,49
SERVICE POINT SOLUTIONS, S.A.	ES0143421G11	SPS/AC 0,60			3,17
SNIACE, S.A.	ES0165380017	SNC/AC 0,10			3,57
SOCIEDAD ANONIMA DAMM	ES0125690513	DAMM/AC 0,20			13,20
SOCIEDAD ANONIMA HULLERA VASCO-LEONESA	ES0146940012	HULLERA.VAS-LE/AC 3,01			7,67
SOCIEDAD ESPAÑOLA DEL ACUMULADOR TUDOR, S.A.	ES0131600019	TUD/AC 3,01			9,90
SOCIEDAD GENERAL DE AGUAS DE BARCELONA, S.A.	ES0141330C19	AGS/AC 1,00			27,49
SOGECABLE, S.A.	ES0178483139	SGC/AC A 2,00			26,21
SOL MELIA, S.A.	ES0176252718	SOL/AC 0,20			12,57
SOLARIA ENERGIA Y MEDIOAMBIENTE, S.A.	ES0165386014	SLR/AC 0,01			19,19
SOS CUETARA, S.A.	ES0110047919	SOS/AC 1,50			14,03
SOTOGRADE, S.A.	ES0138109014	STG/AC 0,60			14,04
TAVEX ALGODONERA, S.A.	ES0108180219	ASA/AC 0,92			2,26
TECNICAS REUNIDAS, S.A.	ES0178165017	TRE/AC 0,10			52,10
TECNOCOM, TELECOMUNICACIONES Y ENERGIA, S.A.	ES0147582B12	CIB/AC 0,50			5,07
TELEFONICA, S.A.	ES0178430E18	TEF/AC 1,00			22,13
TELEFONOS DE MEXICO, S.A.	MXP904131325	AC. TELMEX. S/L			24,89
TESTA INMUEBLES EN RENTA, S.A.	ES0170885018	TST/AC 6,00			22,78
TUBACEX, S.A.	ES0132945017	TUB/AC 0,45			7,19
TUBOS REUNIDOS, S.A.	ES0180850416	TRG/AC 0,10			5,27
TV AZTECA, S.A. DE C.V.	MXP740471117	AC. TV AZTECA			3,98
UNION EUROPEA DE INVERSIONES, S.A.	ES0181480114	U.EUROPEA.INV/AC 1,00			26,70
UNION FENOSA, S.A.	ES0181380017	UNF/AC 3,00			45,44
UNIPAPEL, S.A.	ES0182045312	UPL/AC 1,50			20,65
URALITA, S.A.	ES0182170615	URA/AC 0,72			6,83
URBAR INGENIEROS, S.A.	ES0182484214	URBAR.ING/AC 0,50			7,69
URBAS GUADAHERMOSA, S.A.	ES0182280018	URBAS/AC 0,64			1,26
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNOR3	AC. USIMINAS			48,33
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNPA6	AC. USIMINAS -PREF.-			45,07
VALE DO RIO DOCE, COMPANHIA	BRVALEACNOR0	AC. VALE DO RIO DOCE			23,83
VALE DO RIO DOCE, COMPANHIA	BRVALEACNPA3	AC. VALE DO RIO DOCE. PREF. 6%			20,02
VERTICE TRESIENTOS SESENTA GRADOS, S.A.	ES0183304312	VERTICE.360/AC 0,50			2,42
VIDRALA, S.A.	ES0183746314	VID/AC 1,02			25,89
VISCOFAN, S.A.	ES0184262212	VIS/AC 0,30			16,75
VOCENTO, S.A.	ES0114820113	VOC/AC 0,20			15,08
VOLCAN COMPAÑIA MINERA, S.A.A.	PEP648014202	AC. VOLCAN. PREF. S/B			26,95
VUELING AIRLINES, S.A.	ES0184591032	VLG/AC 1,00			13,89
ZARDOYA OTIS, S.A.	ES0184933812	ZOT/AC 0,10			22,08
ZELTIA, S.A.	ES0184940817	ZEL/AC 0,05			7,37