

III. OTRAS DISPOSICIONES

MINISTERIO DE HACIENDA Y ADMINISTRACIONES PÚBLICAS

- 2308** *Orden HAP/313/2014, de 28 de febrero, por la que se aprueba la relación de valores negociados en mercados organizados, con su valor de negociación medio correspondiente al cuarto trimestre de 2013, a efectos de la declaración del Impuesto sobre el Patrimonio del año 2013 y de la declaración informativa anual acerca de valores, seguros y rentas.*

La Ley 16/2012, de 27 de diciembre, por la que se adoptan diversas medidas tributarias dirigidas a la consolidación de las finanzas públicas y al impulso de la actividad económica, prorrogó durante el ejercicio 2013 la vigencia del Impuesto sobre el Patrimonio, restablecido con carácter temporal, para los años 2011 y 2012, por el Real Decreto-ley 13/2011, de 16 de septiembre, obligando a presentar declaración a los sujetos pasivos cuya cuota tributaria, determinada de acuerdo con las normas reguladoras del Impuesto y, una vez aplicadas las deducciones o bonificaciones que procedieren, resulte a ingresar, o cuando, no dándose esta circunstancia, el valor de sus bienes o derechos, determinados de acuerdo con las normas reguladoras del Impuesto, resulte superior a 2.000.000 de euros.

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

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

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

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

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

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

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

En su virtud, dispongo:

Artículo único. Aprobación de las relaciones de valores negociados.

Se aprueba la relación de valores negociados en Bolsa con su cotización media correspondiente al cuarto trimestre de 2013; 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 2013, anexas a esta Orden, a efectos de la declaración del Impuesto sobre el Patrimonio del ejercicio 2013 y para la cumplimentación de la declaración informativa anual acerca de valores, seguros y rentas, aprobada por la Orden EHA/3481/2008, de 1 de diciembre, por la que se aprueba el modelo 189 de declaración informativa anual acerca de valores, seguros y rentas, los diseños físicos y lógicos para la sustitución de las hojas interiores de dicho modelo por soportes directamente legibles por ordenador y se establecen las condiciones y el procedimiento para su presentación telemática.

Disposición final única. Entrada en vigor.

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

Madrid, 28 de febrero de 2014.–El Ministro de Hacienda y Administraciones Públicas, Cristóbal Montoro Romero.

ANEXO

Relación de valores o participaciones con su valor de negociación medio o de liquidación media relativa al cuarto trimestre de 2013, a efectos previstos en el artículo 39 del Real Decreto 1.065/2007, de 27 de julio, por el que se aprueba el Reglamento General de la actuación y los procedimientos de gestión e inspección tributaria y de desarrollo de las normas comunes de los procedimientos de aplicación de los tributos.

Criterio de ordenación:

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

RENTA FIJA

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

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
COMUNIDAD AUTONOMA DE CANARIAS	ES0000093411	CC.AA.CANA/1,75 BO 20181204	04/12/2018	1,750	100,000
COMUNIDAD AUTONOMA DE CASTILLA Y LEON	ES0001351149	CC.AA.C-LE/5,15 OB SEGR 20171205	05/12/2017	5,150	108,550
COMUNIDAD AUTONOMA DE CASTILLA Y LEON	ES0001351222	CC.AA.C-LE/4,30 BOSEGR 20140507	07/05/2014	4,300	101,650
COMUNIDAD AUTONOMA DE CASTILLA Y LEON	ES0001351339	CC.AA.C-LE/6,27 OBSEGR 20180219	19/02/2018	6,270	113,000
COMUNIDAD AUTONOMA DE CASTILLA Y LEON	ES0001351347	CC.AA.C-LE/6,505 OBSEGR 20190301	01/03/2019	6,505	114,915
COMUNIDAD AUTONOMA DE LA REGION DE MURCIA	ES0000102220	CC.AA.MUR/5,50 BO 20140509 B	09/05/2014	5,500	99,500
COMUNIDAD AUTONOMA DE LA RIOJA	ES0000103020	CC.AA.RIOJA/4,31 OBSEGR 20180615	15/06/2018	4,310	105,050
COMUNIDAD AUTONOMA DE LAS ISLAS BALEARES	ES0001348236	CC.AA.BAL/5,50 BO 20140214	14/02/2014	5,500	100,000
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101263	CC.AA.MAD/4,30 OB 20260915	15/09/2026	4,300	91,328
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101313	CC.AA.MAD/4,99 OB 20180617	17/06/2018	4,990	108,358
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101339	CC.AA.MAD/4,305 BO 20140306	06/03/2014	4,305	101,025
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101388	CC.AA.MAD/4,622 BO 20150623	23/06/2015	4,622	104,212
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101396	CC.AA.MAD/4,688 OB 20200312	12/03/2020	4,688	103,936
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101495	CC.AA.MAD/5,50 BO 20170214	14/02/2017	5,500	109,200
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101503	CC.AA.MAD/4,75 BO 20150326	26/03/2015	4,750	104,321
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101545	CC.AA.MAD/5,75 BO 20180201	01/02/2018	5,750	110,829
COMUNIDAD FORAL DE NAVARRA	ES0001353228	CC.AA.NAV/4,00 OB 20211123	23/11/2021	4,000	99,735
COMUNIDAD FORAL DE NAVARRA	ES0001353293	CC.AA.NAV/5,80 OB 20180609	09/06/2018	5,800	112,850
DIPUTACION FORAL DE VIZCAYA	ES0201570001	DIPT.VIZCAYA/11,30 OB 20141220	20/12/2014	11,300	118,858
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011868	ESTADO/6,00 OBE SEGR 20290131	31/01/2029	6,000	113,600
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011876	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20290131	31/01/2029	C	47,629
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011884	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20140131	31/01/2014	C	99,862
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011892	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20150131	31/01/2015	C	98,303
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011900	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20160131	31/01/2016	C	96,398
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011918	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170131	31/01/2017	C	92,994
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011926	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20180131	31/01/2018	C	89,473
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011934	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20190131	31/01/2019	C	85,456
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011942	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20200131	31/01/2020	C	80,867
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011959	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20210131	31/01/2021	C	77,477
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011983	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20240131	31/01/2024	C	64,638
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011991	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20250131	31/01/2025	C	61,048
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012007	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20260131	31/01/2026	C	56,837
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012023	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20270131	31/01/2027	C	52,756
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012049	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20290131	31/01/2029	C	46,882
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012098	ESTADO/4,75 OBE SEGR 20140730	30/07/2014	4,750	102,601
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120C3	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20150131	31/01/2015	C	98,794
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120G4	ESTADO/3,15 OBE SEGR 20160131	31/01/2016	3,150	103,251
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120I0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20160131	31/01/2016	C	96,617
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120J8	ESTADO/3,80 OBE SEGR 20170131	31/01/2017	3,800	105,252
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120M2	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20170131	31/01/2017	C	93,973
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120N0	ESTADO/4,90 OBE SEGR 20400730	30/07/2040	4,900	98,567
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120O8	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20400730	30/07/2040	C	26,537
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120P5	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20330730	30/07/2033	C	36,738
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120Q3	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20340730	30/07/2034	C	34,652
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120W1	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20400730	30/07/2040	C	25,214
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121A5	ESTADO/4,10 OBE SEGR 20180730	30/07/2018	4,100	106,516
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121F4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20180730	30/07/2018	C	87,759
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121G2	ESTADO/4,80 OBESEGR 20240131	31/01/2024	4,800	105,335
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121H0	ESTADO/4,25 BOEST SEGR 20140131	31/01/2014	4,250	100,797
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121K4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20240131	31/01/2024	C	66,014
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121L2	ESTADO/4,60 OBESEGR 20190730	30/07/2019	4,600	108,299
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121O6	ESTADO/4,30 OBESEGR 20191031	31/10/2019	4,300	105,124
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121P3	ESTADO/3,30 BOEST SEGR 20141031	31/10/2014	3,300	102,371
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121R9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20190730	30/07/2019	C	82,820
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121S7	ESTADO/4,70 OBESEGR 20410730	30/07/2041	4,700	95,753

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121V1	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20191031	31/10/2019	C	82,978
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121X7	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20141031	31/10/2014	C	99,065
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121Y5	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20151031	31/10/2015	C	96,584
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121Z2	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20161031	31/10/2016	C	93,140
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122A3	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20171031	31/10/2017	C	90,196
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122B1	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20181031	31/10/2018	C	85,512
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122C9	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20191031	31/10/2019	C	84,007
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122D7	ESTADO/4,00 OBESEGR 20200430	30/04/2020	4,000	103,904
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122E5	ESTADO/4,65 OBESEGR 20250730	30/07/2025	4,650	102,695
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122F2	ESTADO/3,00 BOEST SEGR 20150430	30/04/2015	3,000	102,380
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122G0	ESTADO/VAR BOEST SEGR 20150317	17/03/2015	V	99,354
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122I6	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20200430	30/04/2020	C	80,573
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122N6	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170430	30/04/2017	C	91,647
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122O4	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20180430	30/04/2018	C	87,880
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122Q9	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20200430	30/04/2020	C	78,412
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122S5	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20150430	30/04/2015	C	97,930
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122T3	ESTADO/4,85 OBESEGR 20201031	31/10/2020	4,850	107,821
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122V9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20410730	30/07/2041	C	24,117
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122X5	ESTADO/3,25 BOESTSEGR 20160430	30/04/2016	3,250	103,586
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122Z0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20201031	31/10/2020	C	77,827
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012304	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20140730	30/07/2014	C	99,484
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012353	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20140730	30/07/2014	C	99,305
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123A1	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20201031	31/10/2020	C	78,303
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123B9	ESTADO/5,50 OBESEGR 20210430	30/04/2021	5,500	111,922
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123C7	ESTADO/5,90 OBESEGR 20260730	30/07/2026	5,900	114,440
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123D5	ESTADO/3,40 BOESTSEGR 20140430	30/04/2014	3,400	101,129
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123E3	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20160430	30/04/2016	C	95,650
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123F0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20210430	30/04/2021	C	75,491
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123I4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20260730	30/07/2026	C	57,400
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123J2	ESTADO/4,25 BOESTSEGR 20161031	31/10/2016	4,250	106,613
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123K0	ESTADO/5,85 OBESEGR 20220131	31/01/2022	5,850	113,604
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123L8	ESTADO/4,00 BOESTSEGR 20150730	30/07/2015	4,000	104,367
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123N4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20220131	31/01/2022	C	72,914
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123P9	ESTADO/3,75 BOESTSEGR 20151031	31/10/2015	3,750	104,327
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123Q7	ESTADO/4,50 BOESTSEGR 20180131	31/01/2018	4,500	106,606
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123S3	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20151031	31/10/2015	C	97,400
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123T1	ESTADO/2,75 BOESTSEGR 20150331	31/03/2015	2,750	102,163
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123U9	ESTADO/5,40 OBESEGR 20230131	31/01/2023	5,400	110,319
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123V7	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20180131	31/01/2018	C	88,618
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123W5	ESTADO/3,30 BOESTSEGR 20160730	30/07/2016	3,300	103,893
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123X3	ESTADO/4,40 OBESEGR 20231031	31/10/2023	4,400	102,264
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012411	ESTADO/5,75 OBESEGR 20320730	30/07/2032	5,750	111,831
ESTADO ESPAÑOL	ES00000124B7	ESTADO/3,75 BOESTSEGR 20181031	31/10/2018	3,750	104,357
ESTADO ESPAÑOL	ES00000124C5	ESTADO/5,15 OBESEGR 20281031	31/10/2028	5,150	105,501
ESTADO ESPAÑOL	ES00000124H4	ESTADO/5,15 OBESEGR 20441031	31/10/2044	5,150	101,214
ESTADO ESPAÑOL	ES00000124I2	ESTADO/2,10 BOESTSEGR 20170430	30/04/2017	2,100	99,950
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012601	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20150730	30/07/2015	C	97,641
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012619	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20160730	30/07/2016	C	94,863
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012627	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170730	30/07/2017	C	90,498
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012643	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20190730	30/07/2019	C	84,031
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012668	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20210730	30/07/2021	C	73,375
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012684	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20230730	30/07/2023	C	66,465
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012692	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20240730	30/07/2024	C	61,205
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012726	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20270730	30/07/2027	C	52,497
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012734	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20280730	30/07/2028	C	49,131
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012742	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20290730	30/07/2029	C	45,722
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012759	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20300730	30/07/2030	C	44,024
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012767	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20310730	30/07/2031	C	42,198
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012775	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20320730	30/07/2032	C	38,767
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012783	ESTADO/5,50 OBE SEGR 20170730	30/07/2017	5,500	111,414
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012916	ESTADO/4,40 OBE SEGR 20150131	31/01/2015	4,400	104,082
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012932	ESTADO/4,20 OBE SEGR 20370131	31/01/2037	4,200	89,653
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012981	ESTADO/CUPCER BOEST 20340131	31/01/2034	C	35,678
FONDO DE REESTRUCTURACION ORDENADA BANCARIA	ES0302761004	FROB/3,00 BO 20141119 GTIA	19/11/2014	3,000	102,067
FONDO DE REESTRUCTURACION ORDENADA BANCARIA	ES0302761012	FROB/4,50 BO 20140203 GTIA	03/02/2014	4,500	100,280
FONDO DE REESTRUCTURACION ORDENADA BANCARIA	ES0302761020	FROB/5,50 BO 20160712 GTIA	12/07/2016	5,500	108,870
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950E9	GENCAT/4,95 OB 20200211	11/02/2020	4,950	98,468
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950F6	GENCAT/5,75 BO 20150625	25/06/2015	5,750	105,737
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095838	GENCAT/4,35 OB 20140716	16/07/2014	4,350	101,043
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095861	GENCAT/3,875 OB 20150915	15/09/2015	3,875	100,375
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095879	GENCAT/4,22 OB 20350426	26/04/2035	4,220	67,371
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095895	GENCAT/4,30 OB 20161115	15/11/2016	4,300	102,674
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095929	GENCAT/4,75 OB 20180604	04/06/2018	4,750	100,828
GOBIERNO VASCO	ES0000106429	GOB.VASCO/5,55 OB 20141126	26/11/2014	5,550	109,788
GOBIERNO VASCO	ES0000106437	GOB.VASCO/4,15 OB 20191028	28/10/2019	4,150	106,091
GOBIERNO VASCO	ES0000106445	GOB.VASCO/4,60 BO 20250107	07/01/2025	4,600	105,743
GOBIERNO VASCO	ES0000106486	GOB.VASCO/4,75 OB 20170705	05/07/2017	4,750	109,082

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
GOBIERNO VASCO	ES0000106494	GOB.VASCO/3,99 OB 20160128	28/01/2016	3,990	107,240
GOBIERNO VASCO	ES0000106510	GOB.VASCO/6,375 OB 20210420	20/04/2021	6,375	118,237
GOBIERNO VASCO	ES0000106528	GOB.VASCO/4,90 OB 20200326	26/03/2020	4,900	108,449
JUNTA DE ANDALUCIA	ES0000090714	JUNTA.AND/4,85 OBSEGR 20200317	17/03/2020	4,850	102,000
JUNTA DE ANDALUCIA	ES0000090789	JUNTA.AND/5,50 BO 20140321	21/03/2014	5,500	99,992
XUNTA DE GALICIA	ES0001352238	XUNTA/3,70 OB 20150411	11/04/2015	3,700	102,550
XUNTA DE GALICIA	ES0001352303	XUNTA/4,805 OB 20200326	26/03/2020	4,805	102,950
XUNTA DE GALICIA	ES0001352469	XUNTA/5,763 BO 20170403	03/04/2017	5,763	109,773
XUNTA DE GALICIA	ES0001352519	XUNTA/2,75 BO 20170202	02/02/2017	2,750	101,050

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

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950K6	GENCAT/VAR BO 20150330	30/03/2015	V	101,363
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950S9	GENCAT/5,00 BO 20140429	29/04/2014	5,000	100,792
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0255281109	INST.CAT.FIN/4,54 OB 20190918	18/09/2019	4,540	95,006
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0555281031	ICF/PAG 20140530	30/05/2014		98,788
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0555281049	ICF/PAG 20141128	28/11/2014		97,580
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0555281171	ICF/PAG 20140930	30/09/2014		97,352
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0555281205	ICF/PAG 20150930	30/09/2015		94,428

LETRAS DEL TESORO

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01401246	ESTADO/LT 20140124	24/01/2014	C	99,933
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01402210	ESTADO/LT 20140221	21/02/2014	C	99,865
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01403143	ESTADO/LT 20140314	14/03/2014	C	99,779
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01404166	ESTADO/LT 20140416	16/04/2014	C	99,748
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01405163	ESTADO/LT 20140516	16/05/2014	C	99,664
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01406203	ESTADO/LT 20140620	20/06/2014	C	99,632
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01407185	ESTADO/LT 20140718	18/07/2014	C	99,508
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01408225	ESTADO/LT 20140822	22/08/2014	C	99,397
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01409199	ESTADO/LT 20140919	19/09/2014	C	99,378
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01410171	ESTADO/LT 20141017	17/10/2014	C	99,427
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01411211	ESTADO/LT 20141121	21/11/2014	C	99,224
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01412128	ESTADO/LT 20141212	12/12/2014	C	99,035

OBLIGACIONES

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845179	ABE/4,75 OB 20140211	11/02/2014	4,750	101.064,68
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845203	ABE/4,375 OB 20200330	30/03/2020	4,375	109.007,27
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845211	ABE/5,125 OB 20170612	12/06/2017	5,125	55.581,62
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845237	ABE/4,625 OB 20161014	14/10/2016	4,625	54.279,24
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845252	ABE/4,75 OB 20191025	25/10/2019	4,750	111.335,30
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845260	ABE/3,75 OB 20230620	20/06/2023	3,750	100.611,60
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR LEONESA, S.A.	ES0211843083	AUCALSA/4,00 OB 20140608	08/06/2014	4,000	501,01
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR LEONESA, S.A.	ES0211843091	AUCALSA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	497,87
AUTOPISTA VASCO-ARAGONESA, C.E. S.A.	ES0211837077	AVASA/3,55 OB 20150615	15/06/2015	3,550	1.002,83
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839131	AUDASA/4,00 OB 20140608	08/06/2014	4,000	502,39
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839149	AUDASA/3,32 OB 20151212	12/12/2015	3,320	499,54
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839156	AUDASA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	501,24
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839164	AUDASA/4,85 OB 20180327 GTIA	27/03/2018	4,850	508,54
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839172	AUDASA/6,00 OB 20210531 GTIA	31/05/2021	6,000	524,02
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839180	AUDASA/5,75 OB 20220516 GTIA	16/05/2022	5,750	615,90
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839198	AUDASA/5,20 OB 20230626 GTIA	26/06/2023	5,200	497,75
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211099	BBVA/VAR OB SUBD 20191020	20/10/2019	V	92.959,88
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211107	BBVA/VAR OB SUBD 20220216	16/02/2022	V	46.493,84
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211198	BBVA/2,92 OB 20200121	21/01/2020	2,920	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214973051	CA.SABADELL/VAR OB SUBD 20200128	28/01/2020	V	84.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214973069	CA.SABADELL/VAR OB SUBD 20170215	15/02/2017	V	45.827,17
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214974042	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20190730	30/07/2019	V	949,90
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214974059	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20210809	09/08/2021	V	92.290,62
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214974091	CA.TERRASSA/VAR OB 20170627	27/06/2017	V	92.878,55
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214974117	CA.TERRASSA/VAR OBSUBD 20190929	29/09/2019	V	1.015,52
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA, S.A.	ES0215474224	CA.ESPAÑA/VAR OB 20140326	26/03/2014	V	98.153,76
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213580022	GUI/4,20 OB SUBD 20141015	15/10/2014	4,200	500,91
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213580030	GUI/VAR OB SUBD 20160321	21/03/2016	V	91.000,01
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860036	SAB/VAR OB SUBD 20160525	25/05/2016	V	92.941,79
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860051	SAB/6,25 OBSUBD 20200426	26/04/2020	6,250	51.902,16
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860119	SAB/VAR OBESTR 20181001	01/10/2018	V	99.846,58
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0214400055	CAM/VAR OB 20150815	15/08/2015	V	899,47
BANCO ETCHEVERRIA, S.A.	ES0213441019	BCO.ETCHEVERRIA/VAR OBSUBD 20151220	20/12/2015	V	997,27
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051057	BCO.GALLEGO/2,00 OB 20191229	29/12/2019	2,000	31,40
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790001	POP/VAR OBSUBD 20191222	22/12/2019	V	47.075,10
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790019	POP/8,00 OBSUBD 20210729	29/07/2021	8,000	1.087,18
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790027	POP/8,25 OBSUBD 20211019	19/10/2021	8,250	1.097,22
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790035	POP/6,75 OBSUBD CONV 20180404	31/01/2014	6,750	94,82
BANKIA, S.A.	ES0214977060	BANCAJA/3,94 OB 20150918	18/09/2015	3,940	989,99
BANKIA, S.A.	ES0214977094	BANCAJA/VAR OB 20160125	25/01/2016	V	95.240,25
BANKIA, S.A.	ES0214977144	BANCAJA/4,375 OB 20170214	14/02/2017	4,375	101.993,53
BANKIA, S.A.	ES0214977151	BANCAJA/VAR OB 20140423	23/04/2014	V	49.597,31
BANKINTER, S.A.	ES0213679030	BKT/6,00 OB SUBD 20281218	18/12/2028	6,000	5.689,03
BANKINTER, S.A.	ES0213679139	BKT/VAR OB SUBD 20160321	21/03/2016	V	92.867,35
BANKINTER, S.A.	ES0213679147	BKT/VAR OB SUBD 20160623	23/06/2016	V	93.750,00
BANKINTER, S.A.	ES0213679170	BKT/VAR OB SUBD 20170316	16/03/2017	V	92.750,00
BANKINTER, S.A.	ES0213679196	BKT/6,375 OBSUBD 20190911	11/09/2019	6,375	53.873,08
BANKINTER, S.A.	ES0213679295	BKT/VAR OBESTR 20180430 XIII	30/04/2018	V	49.604,76
BANKINTER, S.A.	ES0213679394	BKT/VAR OBESTR 20180723 XXXII	23/07/2018	V	49.468,26
BANKINTER, S.A.	ES0213679477	BKT/VAR OBESTR 20180807 XLIII	07/08/2018	V	49.717,79
BANKINTER, S.A.	ES0213679535	BKT/VAR OBESTR 20180820 LII	20/08/2018	V	49.217,67
BANKINTER, S.A.	ES0213679667	BKT/VAR OBESTR 20181106 LXX	06/11/2018	V	25.000,00
BANKINTER, S.A.	ES0213679717	BKT/VAR OBESTR 20181102 LXXV	02/11/2018	V	99.967,91
BANKINTER, S.A.	ES0213679725	BKT/VAR OBESTR 20181102 LXXVII	02/11/2018	V	99.963,90
BANKINTER, S.A.	ES0213679790	BKT/VAR OBESTR 20181129 XC	29/11/2018	V	49.910,89
BBK BANK CAJASUR, S.A.U.	ES0264730054	CAJASUR/VAR OB SUBD 20150311	11/03/2015	V	94.300,42
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0257080004	BPEF/VAR OB SUBD 20140630	30/06/2014	V	980,00
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0257080012	BPEF/VAR OB SUBD 20151223	23/12/2015	V	93.000,00
CAIXABANK, S.A.	ES0213249008	CA.GIRONA/VAR OB SUBD 20160921	21/09/2016	V	94.743,33
CAIXABANK, S.A.	ES0214965008	CAN/VAR OB SUBD 20160616	16/06/2016	V	93.987,56
CAIXABANK, S.A.	ES0214965024	CAN/VAR OBSUBD 20190630	30/06/2019	V	996,67
CAIXABANK, S.A.	ES0214979157	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20151128	28/11/2015	V	923,55
CAIXABANK, S.A.	ES0214979181	CA.GUADALAJ/VAR OBSUBD 20191230	30/12/2019	V	1.021,00
CAIXABANK, S.A.	ES0214981070	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20151104	04/11/2015	V	96.984,34
CAIXABANK, S.A.	ES0217156092	EL.MONTE/VAR OB SUBD PERP		V	74.673,60
CAIXABANK, S.A.	ES0240609000	CABK/4,00 OBSUBD 20220209 I	09/02/2022	4,000	98,73
CAIXABANK, S.A.	ES0240609018	CABK/5,00 OBSUBD 20220209 II	09/02/2022	5,000	103,15
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970065	LACAIXA/VAR OBSUBD 20190228	28/02/2019	V	999,25
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970073	LACAIXA/VAR OBSUBD 20200330	30/03/2020	V	992,58
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970081	LACAIXA/7,50 OBSUBD 20170131	31/01/2017	7,500	1.133,84
CAJAS RURALES UNIDAS, SOCIEDAD COOP. DE CREDITO	ES0214601017	CAJAMAR/VAR OBSUBD 20150316	16/03/2015	V	92.827,65
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0214840276	CA.CATALUNYA/VAR OB 20210321	21/03/2021	V	63.296,58
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICA DE PRODUCTOS PETROLIFEROS	ES0224261018	CORES/4,50 OB 20180423	23/04/2018	4,500	106.450,00
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICA DE PRODUCTOS PETROLIFEROS	ES0224261026	CORES/3,25 OB 20160419	19/04/2016	3,250	102.536,24

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
DEUTSCHE BANK, A.G.	DE0003933693	OB. DEUTSCHE BANK	10/11/2014	4,155	1.017,04
DEUTSCHE BANK, S.A.E.	ES0213320023	DT.BK.SAE/VAR OB SUBD 20140331	31/03/2014	V	97,99
ENAGAS TRANSPORTE, S.A.U.	ES0230960009	ENG/4.375 OB 20150706	06/07/2015	4,375	52.698,12
EROSKI, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429004	EROSKI/VAR OB SUBD PERP		V	7,78
EROSKI, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429038	EROSKI/VAR OB SUBD PERP		V	7,50
FAGOR ELECTRODOMESTICOS, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0235972009	FAGOR/VAR OB SUBD 1ª PERP		V	6,05
FAGOR ELECTRODOMESTICOS, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0235972017	FAGOR/VAR OB SUBD 2ª PERP		V	2,38
FERIA MUESTRARIO INTERNACIONAL DE VALENCIA	ES0236395036	FERIA.VAL/6,04 OB 20270610	10/06/2027	6,040	96.213,68
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0214954135	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20180420	20/04/2018	V	365,00
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0214954150	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20190425	25/04/2019	V	347,62
LIBERBANK, S.A.	ES0268675008	LIBERBK/5,00 OBSUBDCONV 20180717 A	17/07/2018	5,000	2,82
LIBERBANK, S.A.	ES0268675016	LIBERBK/5,00 OBSUBDCONV 20180717 B	17/07/2018	5,000	3,44
LIBERBANK, S.A.	ES0268675024	LIBERBK/7,00 OBSUBDCONV 20180717 C	17/07/2018	7,000	9,44
MAPFRE, S.A.	ES0224244063	MAP/VAR OB SUBD 20370724	24/07/2037	V	48.801,74
MINICENTRALES DOS, S.A.	ES0264101017	MINICENT.DOS/4,81 OB 20341129	29/11/2034	4,810	122.977,92
NCG BANCO, S.A.	ES0214958060	CAIXANOVA/VAR OB 20160531	31/05/2016	V	44.610,18
REPSOL, S.A.	ES0273516007	REP/3,50 OB 20230701	01/07/2023	3,500	482,73
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0213495007	SAN.CONS.FIN/VAR OB SUBD 20160928	28/09/2016	V	47.403,94
TELEFONICA, S.A.	ES0278430964	TEF/VAR OB 20150302	02/03/2015	V	100.331,00
TELEFONICA, S.A.	ES0278430998	TEF/4,184 OB 20221129	29/11/2022	4,184	301,11
UNIVERSIDAD POLITECNICA DE VALENCIA	ES0282103003	UPV/6,60 OB 20221215	15/12/2022	6,600	6.960,50
VIDACAIXA, S.A. DE SEGUROS Y REASEGUROS	ES0283691014	VIDACAIXA/VAR OB SUBD PERP		V	1.003,63

BONOS

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298013	AYT.CCG/3,50 BTA 20160314 II GTIA	14/03/2016	3,500	102.906,21
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298021	AYT.CCG/3,75 BTA 20221214 III GTIA	14/12/2022	3,750	92.419,18
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298054	AYT.CCG/4,00 BTA 20210324 VI GTIA	24/03/2021	4,000	98.162,79
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298070	AYT.CCG/4,25 BTA 20180614 VIII GTIA	14/06/2018	4,250	103.883,53
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298096	AYT.CCG/4,25 BTA 20231025 X GTIA	25/10/2023	4,250	96.844,42
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298104	AYT.CCG/4,00 BTA 20161220 XI GTIA	20/12/2016	4,000	103.921,19
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298112	AYT.CCG/4,00 BTA 20170321 XII GTIA	21/03/2017	4,000	103.048,61
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298120	AYT.CCG/4,75 BTA 20270525 XIII GTIA	25/05/2027	4,750	89.840,48
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298195	AYT.CCG/VAR BTA 20151124 XX GTIA	24/11/2015	V	98.792,06
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298229	AYT.CCG/4,75 BTA 20160615 XXIII	15/06/2016	4,750	105.980,59
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298237	AYT.CCG/4,25 BTA 20140729 XXIV GTIA	29/07/2014	4,250	102.036,34
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298245	AYT.CCG/4,50 BTA 20191202 XXV GTIA	02/12/2019	4,500	99.862,34
AYT CEDULAS CAJAS IX, F.T.A.	ES0312358007	AYT.CED.CA.IX/3,75 BTA 20150331 A	31/03/2015	3,750	102.701,46
AYT CEDULAS CAJAS IX, F.T.A.	ES0312358015	AYT.CED.CA.IX/4,00 BTA 20200331 B	31/03/2020	4,000	99.224,99
AYT CEDULAS CAJAS V, F.T.A.	ES0370148019	AYT.CED.CA.V/4,75 BTA 20181204 B	04/12/2018	4,750	106.178,50
AYT CEDULAS CAJAS VI, F.T.A.	ES0312360003	AYT.CED.CA.VI/4,00 BTA 20140407 A	07/04/2014	4,000	101.105,70
AYT CEDULAS CAJAS VIII, F.T.A.	ES0312362009	AYT.CED.CA.VIII/4,00 BTA 20141118 A	18/11/2014	4,000	102.648,10
AYT CEDULAS CAJAS VIII, F.T.A.	ES0312362017	AYT.CED.CA.VIII/4,25 BTA 20191118 B	18/11/2019	4,250	103.817,22
AYT CEDULAS CAJAS X, F.T.A.	ES0312342001	AYT.CED.CA.X/VAR BTA 20150630 A	30/06/2015	V	97.395,30
AYT CEDULAS CAJAS X, F.T.A.	ES0312342019	AYT.CED.CA.X/3,75 BTA 20250630 B	30/06/2025	3,750	86.142,71
AYT DEUDA SUBORDINADA I, F.T.A.	ES0312284005	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 A	17/11/2016	V	55.888,95
AYT DEUDA SUBORDINADA I, F.T.A.	ES0312284021	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 C	17/11/2016	V	2.200,00
AYT FONDO EOLICO, F.T.A.	ES0312376009	AYT.EOLICO/VAR BTA 20141125 E1 GTIA	25/11/2014	V	483,79
AYT GENOVA HIPOTECARIO II, F.T.H.	ES0370139000	AYT.GEN.H.II/VAR BTH 20341215 A	15/12/2034	V	23.040,82
AYT GENOVA HIPOTECARIO III, F.T.H.	ES0370143002	AYT.GEN.H.III/VAR BTH 20350715 A	15/07/2035	V	25.786,77
AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, F.T.H.	ES0370150007	AYT.GEN.H.IV/VAR BTH 20360516 A	16/05/2036	V	28.109,93
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, F.T.H.	ES0312300017	AYT.GEN.H.IX/VAR BTH 20390715 A2	15/07/2039	V	28.699,56
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, F.T.H.	ES0312343017	AYT.GEN.H.VII/VAR BTH 20380915 A2	15/09/2038	V	24.573,13
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, F.T.H.	ES0312344015	AYT.GEN.H.VIII/VAR BTH 20390515 A2	15/05/2039	V	24.207,22
AYT HIPOTECARIO III, F.T.H.	ES0312369004	AYT.HIP.III/VAR BTH 20330318 A GTIA	18/03/2033	V	16.325,31
AYT HIPOTECARIO MIXTO II, F.T.A.	ES0370151005	AYT.HIP.MIX.II/VAR BTA 20360620 PH1	20/06/2036	V	23.136,98
AYT HIPOTECARIO MIXTO II, F.T.A.	ES0370151039	AYT.HIP.MIX.III/VAR BTA 20360620 CH2	20/06/2036	V	69.493,49
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, F.T.A.	ES0312378013	AYT.HIP.MIX.III/VAR BTA 20380321 B	21/03/2038	V	29.250,00
AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, F.T.A.	ES0370152003	AYT.HIP.MIX.IV/VAR BTA 20400120 A	20/01/2040	V	28.807,09
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, F.T.A.	ES0312252028	AYT.HIP.MIX.V/VAR BTA 20410610 C	10/06/2041	V	31.494,86
AYT PRESTAMOS CONSUMO III, F.T.A.	ES0312372016	AYT.PREST.C.III/VAR BTA 20210115 B	15/01/2021	V	23.419,11
AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS III, F.T.A.	ES0312379003	AYT.INMO.III/VAR BTA 20461215 A	15/12/2046	V	18.009,59
AYT 2, F.T.H.	ES0312406012	AYT.2/VAR BTH 20321220 A2 GTIA	20/12/2032	V	5.593,54
BANCAJA 10, F.T.A.	ES0312872015	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 A2 GTIA	22/05/2050	V	44.081,14
BANCAJA 10, F.T.A.	ES0312872049	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 C GTIA	22/05/2050	V	30.073,99
BANCAJA 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312885017	BANCAJA.6/VAR BTA 20360220 A2 GTIA	20/02/2036	V	17.394,08
BANCAJA 8, F.T.A.	ES0312887005	BANCAJA.8/VAR BTA 20371025 A GTIA	25/10/2037	V	24.908,34
BANCAJA 9, F.T.A.	ES0312888045	BANCAJA.9/VAR BTA 20430925 D GTIA	25/09/2043	V	12.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211676	BBVA/4,27 BO 20140315	15/03/2014	4,270	101.345,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211866	BBVA/CUPCER BO 20151103	03/11/2015	C	95.759,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211874	BBVA/CUPCER BO 20151116	16/11/2015	C	95.759,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211882	BBVA/0,96 BO 20150116	16/01/2015	0,960	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211890	BBVA/1,34 BO 20151127	27/11/2015	1,340	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211908	BBVA/2,20 BO 20171010	10/10/2017	2,200	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211916	BBVA/2,35 BO 20180316	16/03/2018	2,350	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0314973118	CA.SABADELL/3,111 BO 20141127 GTIA	27/11/2014	3,111	50.630,00
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0313377030	BCO.COOP.ESP/3,125 BO 20150122 GTIA	22/01/2015	3,125	50.907,16
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA, S.A.	ES0314854128	CAJADUERO/3,00 BO 20150504 GTIA	04/05/2015	3,000	50.866,25
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313212021	BCO.CAM/4,50 BO 20170309 GTIA	09/03/2017	4,500	50.059,99
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860357	SAB/4,25 BO 20140504 II	04/05/2014	4,250	1.007,03
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860399	SAB/CUPCER BOESTR 20150727	27/07/2015	C	61.210,38
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860449	SAB/VAR BOSUBDCONV 20150721 SER I	21/07/2015	V	479,88
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860456	SAB/10,20 BOSUBDCONV 20151111SER II	11/11/2015	10,200	2,48
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860464	SAB/VAR BOESTR 20160208	06/02/2016	V	95.789,73
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860589	SAB/5,00 BOSUBDCONV 20161028 III	28/10/2016	5,000	1,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860597	SAB/5,00 BOSUBDCONV 20171028 IV	28/10/2017	5,000	1,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860605	SAB/VAR BOESTR 20151102 15	02/11/2015	V	96.922,47
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860613	SAB/2,50 BO 20161205	05/12/2016	2,500	99.769,70
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0314400187	CAM/3,00 BO 20141112 GTIA	12/11/2014	3,000	50.944,96
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0314950678	CA.MADRID/4,375 BO 20151130 GTIA	30/11/2015	4,375	52.266,84
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0314950694	CA.MADRID/5,25 BO 20160407 GTIA	07/04/2016	5,250	53.763,77
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0314977358	BANCAJA/3,00 BO 20141027 GTIA	27/10/2014	3,000	50.847,93
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0314977366	BANCAJA/3,125 BO 20150121 GTIA	21/01/2015	3,125	51.052,15
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0314977374	BANCAJA/VAR BO 20140430 GTIA	30/04/2014	V	49.986,36
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0335701001	CAJATRES/CUPCER BO 20140629 A	29/06/2014	C	71.074,88
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0335701019	CAJATRES/CUPCER BO 20160525 B	25/05/2016	C	17.875,97
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0314966187	CA.PENEDES/VAR BO 20150506 GTIA	06/05/2015	V	49.200,00
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0313790059	POP/7,00 BOSUBDCONV 20151125	25/11/2015	7,000	328,76
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0313440143	BTO/4,08 BO 20160323	23/03/2016	4,080	105.174,38

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0313440150	BTO/3,00 BO 20150417	17/04/2015	3,000	1.019,05
BANKINTER 10, F.T.A.	ES0313529010	BKT.10/VAR BTA 20430621 A2 GTIA	21/06/2043	V	39.633,00
BANKINTER 11, F.T.H.	ES0313714018	BKT.11/VAR BTH 20480821 A2 GTIA	21/08/2048	V	40.080,03
BANKINTER 2 PYME, F.T.A.	ES0313716039	BKT.2.PYME/VAR BTA 20430516 C GTIA	16/05/2043	V	71.000,19
BANKINTER 2 PYME, F.T.A.	ES0313716047	BKT.2.PYME/VAR BTA 20430516 D GTIA	16/05/2043	V	45.509,17
BANKINTER 3 FTPYME, F.T.A.	ES0313273015	BKT.3.PYME/VAR BTA 20460218 A2	18/02/2046	V	40.341,69
BANKINTER 3, F.T.H.	ES0314019003	BKT.3/VAR BTH 20381016 A GTIA	16/10/2038	V	13.641,73
BANKINTER 3, F.T.H.	ES0314019011	BKT.3/VAR BTH 20381016 B GTIA	16/10/2038	V	20.349,62
BANKINTER 4, F.T.H.	ES0313919005	BKT.4/VAR BTH 20381112 A GTIA	12/11/2038	V	19.387,55
BANKINTER 6, F.T.A.	ES0313546006	BKT.6/VAR BTA 20380826 A GTIA	26/08/2038	V	24.361,54
BANKINTER 7, F.T.H.	ES0313547004	BKT.7/VAR BTH 20400926 A GTIA	26/09/2040	V	24.010,30
BANKINTER 9, F.T.A.	ES0313814016	BKT.9/VAR BTA 20420716 A2P GTIA	16/07/2042	V	34.488,80
BANKINTER 9, F.T.A.	ES0313814057	BKT.9/VAR BTA 20420716 A2T GTIA	16/07/2042	V	37.472,91
BANKINTER, S.A.	ES0313679575	BKT/7,00 BOSUBDCONV 20140511 SER I	11/05/2014	7,000	54,10
BANKINTER, S.A.	ES0313679583	BKT/7,00 BOSUBDCONV 20140511 SER II	11/05/2014	7,000	66,32
BANKINTER, S.A.	ES0313679740	BKT/VAR BOESTR 20161227	27/12/2016	V	4.668,03
BBVA AUTOS 2, F.T.A.	ES0333761007	BBVA.AUTOS.2/VAR BTA 20191120 A	20/11/2019	V	1.014,55
BBVA CONSUMO 1, F.T.A.	ES0333763003	BBVA.CONSUMO.1/VAR BTA 20200120 A	20/01/2020	V	2.238,16
BBVA CONSUMO 2, F.T.A.	ES0313956007	BBVA.CONSUMO.2/VAR BTA 20201220 A	20/12/2020	V	3.088,50
BBVA HIPOTECARIO 3, F.T.A.	ES0314227010	BBVA.HIP.3/VAR BTA 20381121 A2 GTIA	21/11/2038	V	5.685,07
BBVA LEASING 1, F.T.A.	ES0314209000	BBVA.LEASING.1/VAR BTA 20310526 A1	26/05/2031	V	6.948,97
BBVA RMBS 2, F.T.A.	ES0314148042	BBVA.RMBS2/VAR BTA 20500917 B GTIA	17/09/2050	V	46.500,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467308	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20141111 33	11/11/2014	V	49.770,55
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467779	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20160630 83	30/06/2016	V	49.732,34
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467811	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20160225	25/02/2016	C	24.867,31
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467845	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20180619	19/06/2018	C	24.746,95
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467852	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20180619	19/06/2018	C	24.746,92
BBVA-5 FTPYME, F.T.A.	ES0370459002	BBVA5.PYME/VAR BTA 20390315 A1 GTIA	15/03/2039	V	858,64
BBVA-6 FTPYME, F.T.A.	ES0370460000	BBVA6.PYME/VAR BTA 20460322 A1	22/03/2046	V	1.828,51
BBVA-6 FTPYME, F.T.A.	ES0370460034	BBVA6.PYME/VAR BTA 20460322 C	22/03/2046	V	8.031,77
CABILDO INSULAR DE GRAN CANARIA	ES0315301129	CBDO.G.C/1,75 BO 20181204	04/12/2018	1,750	1.000,00
CAIXA PENEDES 1 TDA, F.T.A.	ES0313252019	CA.PENEDES1.TDA/VAR BTA 20430128 B	28/01/2043	V	92.719,56
CAIXA PENEDES 1 TDA, F.T.A.	ES0313252027	CA.PENEDES1.TDA/VAR BTA 20430128 C	28/01/2043	V	92.719,11
CAIXA PENEDES 2 TDA, F.T.A.	ES0347598007	CA.PENEDES2.TDA/VAR BTA 20451028 A	28/10/2045	V	48.354,15
CAIXA PENEDES 2 TDA, F.T.A.	ES0347598015	CA.PENEDES2.TDA/VAR BTA 20451028 B	28/10/2045	V	99.703,87
CAIXA PENEDES 2 TDA, F.T.A.	ES0347598023	CA.PENEDES2.TDA/VAR BTA 20451028 C	28/10/2045	V	99.701,58
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, F.T.A.	ES0357326000	PENEDES.PYMES.1/VAR BTA 20450928 A	28/09/2045	V	14.763,83
CAIXABANK, S.A.	ES0313980056	BVA/2,50 BOCONV 20141215	15/12/2014	2,500	295,37
CAIXABANK, S.A.	ES0314981095	CAJACANARIAS/3,125 BO 20150331 GTIA	31/03/2015	3,125	51.186,75
CAIXABANK, S.A.	ES0314981103	CAJACANARIAS/2,75 BO 20140406 GTIA	06/04/2014	2,750	50.385,00
CAIXABANK, S.A.	ES0340609009	CABK/4,125 BO 20141120	20/11/2014	4,125	51.539,53
CAIXABANK, S.A.	ES0340609017	CABK/7,00 BOSUBDCONV 20150630	30/06/2015	7,000	37,33
CAIXABANK, S.A.	ES0340609041	CABK/VAR BOESTR 20141204	04/12/2014	V	50.164,49
CAIXABANK, S.A.	ES0340609058	CABK/4,91 BO 20150120	20/01/2015	4,910	1.040,19
CAIXABANK, S.A.	ES0340609066	CABK/7,00 BOSUBDCONV 20151230	30/12/2015	7,000	99,06
CAIXABANK, S.A.	ES0340609074	CABK/3,25 BOESTR 20140305	05/03/2014	3,250	50.105,17
CAIXABANK, S.A.	ES0340609082	CABK/VAR BOESTR 20150217	17/02/2015	V	50.658,70
CAIXABANK, S.A.	ES0340609104	CABK/3,25 BO 20160122	22/01/2016	3,250	103.069,89
CAIXABANK, S.A.	ES0340609173	CABK/VAR BOESTR 20160422	22/04/2016	V	109.610,95
CAIXABANK, S.A.	ES0340609181	CABK/VAR BOESTR 20160527	27/05/2016	V	107.034,99
CAIXABANK, S.A.	ES0340609199	CABK/3,125 BO 20180514	14/05/2018	3,125	101.813,74
CAIXABANK, S.A.	ES0340609215	CABK/2,50 BO 20170418	18/04/2017	2,500	99.838,77
CAIXABANK, S.A.	ES0358197038	CAJASOL/3,25 BO 20150225 GTIA	25/02/2015	3,250	50.907,57
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0314840184	CA.CATALUNYA/3,00 BO 20141029 GTIA	29/10/2014	3,000	50.894,24
CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, F.T.A.	ES0318822006	CED.POP.3/4,25 BTA 20170426 GTIA	26/04/2017	4,250	106.033,18
CEDULAS TDA 18, F.T.A.	ES0316990003	CED.TDA.18/3,50 BTA 20170409 A GTIA	09/04/2017	3,500	12.711,89
CEDULAS TDA 21, F.T.A.	ES0316992009	CED.TDA.21/4,25 BTA 20141227 A GTIA	27/12/2014	4,250	20.289,87
CEDULAS TDA 3, F.T.A.	ES0317043000	CED.TDA.3/4,38 BTA 20160303 1 GTIA	03/03/2016	4,375	104.739,42
CEDULAS TDA 5, F.T.A.	ES0317045005	CED.TDA.5/4,13 BTA 20191129 A GTIA	29/11/2019	4,125	101.760,79
CEDULAS TDA 6, F.T.A.	ES0317046003	CED.TDA.6/3,88 BTA 20250523 GTIA	23/05/2025	3,875	85.922,02
CEDULAS TDA 7, F.T.A.	ES0317047001	CED.TDA.7/3,50 BTA 20170620 GTIA	20/06/2017	3,500	101.245,05
CIBELES III FTPYME, F.T.A.	ES0325593012	CIBELESIII.PYME/VAR BTA 20301126 BC	26/11/2030	V	1.620,41
CIBELES III FTPYME, F.T.A.	ES0325593020	CIBELESIII.PYME/VAR BTA 20301126 BS	26/11/2030	V	1.619,41
CM BANCAJA 1, F.T.A.	ES0379349006	CM BANCAJA 1/VAR BTA 20361222 A	22/12/2036	V	795,94
CM BANCAJA 1, F.T.A.	ES0379349014	CM BANCAJA 1/VAR BTA 20361222 B	22/12/2036	V	83.221,10
F.T.A. PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZACION DE CEDULAS HIPOTECARIAS	ES0334699008	PRG.IND.CED.HIP/5,125 BTA 20220720	20/07/2022	5,125	103.693,83
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS PYMES SANTANDER 6	ES0314698004	PYMES.SAN.6/VAR BTA 20560117 A GTIA	17/01/2056	V	100.000,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMPRESAS 2	ES0338058011	SAN.EMPR.2/VAR BTA 20500623 A2 GTIA	23/06/2050	V	342,20
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMPRESAS 3	ES0337710018	SAN.EMPR.3/VAR BTA 20491016 A2 GTIA	16/10/2049	V	9.738,63
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER FINANCIACION 1	ES0382043034	SAN.FINAN.1/VAR BTA 20350720 D GTIA	20/07/2035	V	64.000,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPOTECARIO 2	ES0382042002	SAN.HIP.2/VAR BTA 20490118 A GTIA	18/01/2049	V	32.863,17
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPOTECARIO 2	ES0382042044	SAN.HIP.2/VAR BTA 20490118 E GTIA	18/01/2049	V	28.860,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPOTECARIO 3	ES0338093018	SAN.HIP.3/VAR BTA 20500118 A2 GTIA	18/01/2050	V	47.787,99
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 11	ES0338340005	UCI.11/VAR BTA 20410915 A GTIA	15/09/2041	V	20.655,58
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 14	ES0338341029	UCI.14/VAR BTA 20430620 C GTIA	20/06/2043	V	39.255,12
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 16	ES0338186036	UCI.16/VAR BTA 20490616 C GTIA	16/06/2049	V	7.008,07
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 16	ES0338186044	UCI.16/VAR BTA 20490616 D GTIA	16/06/2049	V	6.922,79

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 6	ES0338558002	UCI.6/VAR BTA 20301116 A GTIA	16/11/2030	V	8.836,08
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 7	ES0338355003	UCI.7/VAR BTA 20330317 A GTIA	17/03/2033	V	10.697,21
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 8	ES0338446000	UCI.8/VAR BTA 20331218 A GTIA	18/12/2033	V	11.141,80
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 9	ES0338222005	UCI.9/VAR BTA 20350619 A GTIA	19/06/2035	V	14.399,26
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, FTYPME SANTANDER 2	ES0338048004	PYME.SAN.2/VAR BTA 20370418 A GTIA	18/04/2037	V	4.479,43
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, HIPOTEBANSA X	ES0338356001	HIPOTEBANSA X/VAR BTA 20340318 A	18/03/2034	V	11.249,80
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, UCI 15	ES0380957003	UCI.15/VAR BTA 20481218 A GTIA	18/12/2048	V	36.861,30
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641007	FADE/4,80 BTA 20140317 1 GTIA	17/03/2014	4,800	101.431,78
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641015	FADE/5,00 BTA 20150617 2 GTIA	17/06/2015	5,000	105.614,87
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641023	FADE/5,90 BTA 20210317 3 GTIA	17/03/2021	5,900	113.299,97
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641031	FADE/5,60 BTA 20180917 4 GTIA	17/09/2018	5,600	112.328,11
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641080	FADE/6,25 BTA 20250317 9 GTIA	17/03/2025	6,250	114.664,82
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641106	FADE/6,50 BTA 20260317 11 GTIA	17/03/2026	6,500	95.797,26
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641114	FADE/4,875 BTA 20171217 12 GTIA	17/12/2017	4,875	108.699,87
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641122	FADE/4,00 BTA 20151217 13 GTIA	17/12/2015	4,000	104.734,66
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641130	FADE/4,125 BTA 20170317 14 GTIA	17/03/2017	4,125	106.155,00
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641155	FADE/3,875 BTA 20180317 16 GTIA	17/03/2018	3,875	104.012,67
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641163	FADE/2,875 BTA 20160917 17 GTIA	17/09/2016	2,875	101.882,33
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641171	FADE/3,375 BTA 20190317 18 GTIA	17/03/2019	3,375	100.343,59
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641189	FADE/2,25 BTA 20161217 19 GTIA	17/12/2016	2,250	99.902,01
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 10	ES0338146006	UCI.10/VAR BTH 20360622 A GTIA	22/06/2036	V	19.503,43
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 10	ES0338146014	UCI.10/VAR BTH 20360622 B GTIA	22/06/2036	V	28.485,83
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 5	ES0338557004	UCI.5/VAR BTH 20290215 A GTIA	15/02/2029	V	6.331,49
FTYPME BANCAJA 2, F.T.A.	ES0339751028	PYME.BANCAJA.2/VAR BTA 20300115 A3G	15/01/2030	V	3.980,98
FTYPME BANCAJA 3, F.T.A.	ES0304501044	PYME.BANCAJA.3/VAR BTA 20371213 C	13/12/2037	V	16.664,99
FTYPME TDA CAM 2, F.T.A.	ES0339758015	PYME.TDA.CAM.2/VAR BTA 20420726 1CA	26/07/2042	V	12.612,30
FTYPME TDA CAM 9, F.T.A.	ES0339754014	PYME.TDA.CAM.9/VAR BTA 20580525 A2G	25/05/2058	V	24.376,69
GAT ICO-FTVPO 1, F.T.H.	ES0341068007	GAT.FTVPO.1/VAR BTH 20360620 AG	20/06/2036	V	57.853,11
GAT ICO-FTVPO 1, F.T.H.	ES0341068011	GAT.FTVPO.1/VAR BTH 20360620 BCP	20/06/2036	V	99.721,34
GAT ICO-FTVPO 1, F.T.H.	ES0341068072	GAT.FTVPO.1/VAR BTH 20360620 CCP	20/06/2036	V	100.000,00
GAT ICO-FTVPO 1, F.T.H.	ES0341068114	GAT.FTVPO.1/VAR BTH 20360620 DCP	20/06/2036	V	92.634,63
GC FTYPME SABADELL 5, F.T.A.	ES0332234014	GC.PYME.SAB.5/VAR BTA 20390331 A2	31/03/2039	V	1.461,58
GC FTYPME SABADELL 8, F.T.A.	ES0341100016	GC.PYME.SAB.8/VAR BTA 20450120 A2G	20/01/2045	V	5.145,97
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, F.T.A.	ES0332235011	GC.PAS.HIP.5/VAR BTA 20460630 A2	30/06/2046	V	49.820,83
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, F.T.A.	ES0332235045	GC.PAS.HIP.5/VAR BTA 20460630 D	30/06/2046	V	99.882,75
HIPOCAT 10, F.T.A.	ES0345671012	HIPOCAT 10/VAR BTA 20391024 A2 GTIA	24/10/2039	V	36.195,71
HIPOCAT 4, F.T.A.	ES0372269003	HIPOCAT 4/VAR BTA 20331215 A GTIA	15/12/2033	V	14.549,72
HIPOCAT 7, F.T.A.	ES0345783015	HIPOCAT 7/VAR BTA 20360715 A2 GTIA	15/07/2036	V	21.062,28
HIPOCAT 7, F.T.A.	ES0345783023	HIPOCAT 7/VAR BTA 20360715 B GTIA	15/07/2036	V	44.386,90
HIPOCAT 8, F.T.A.	ES0345784021	HIPOCAT 8/VAR BTA 20380315 B GTIA	15/03/2038	V	62.841,24
HIPOCAT 8, F.T.A.	ES0345784047	HIPOCAT 8/VAR BTA 20380315 D GTIA	15/03/2038	V	31.184,37
HIPOCAT 9, F.T.A.	ES0345721023	HIPOCAT.9/VAR BTA 20380715 A2B GTIA	15/07/2038	V	39.013,21
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0314954084	IBERCAJA/4,44 BO 20140730 GTIA	30/07/2014	4,440	51.155,03
IM BES EMPRESAS 1, F.T.A.	ES0347430003	IM.BES.EMP.1/VAR BTA 20431120 A	20/11/2043	V	7.756,78
IM CAJAMAR 1, F.T.A.	ES0347851000	IM CAJAMAR 1/VAR BTA 20380124 A	24/01/2038	V	21.927,34
IM CAJAMAR EMPRESAS 2 FTYPME, F.T.A.	ES0347553010	CAJAMAR.EMP.2/VAR BTA 20511024 A2G	24/10/2051	V	25.374,51
IM CEDULAS 1 GRUPO BANCO POPULAR, F.T.A.	ES0347858005	IM CEDULAS 1/4,25 BTA 20140212 GTIA	12/02/2014	4,250	100.620,23
IM CEDULAS 10, F.T.A.	ES0349045007	IM.CED.10/4,50 BTA 20220221 GTIA	21/02/2022	4,500	95.608,35
IM CEDULAS 2, F.T.A.	ES0347859003	IM CEDULAS 2/4,50 BTA 20140611 A	11/06/2014	4,500	102.003,94
IM CEDULAS 3, F.T.A.	ES0347852008	IM.CED.3/4,00 BTA 20141119 GTIA	19/11/2014	4,000	102.466,63
IM CEDULAS 4, F.T.A.	ES0347848006	IM.CED.4/3,75 BTA 20150311 A GTIA	11/03/2015	3,750	102.390,70
IM CEDULAS 5, F.T.A.	ES0347849004	IM CEDULAS 5/3,50 BTA 20200615 GTIA	15/06/2020	3,500	94.738,90
IM CEDULAS 7, F.T.A.	ES0347784003	IM.CED.7/4,00 BTA 20210331 GTIA	31/03/2021	4,000	97.414,95
IM CEDULAS 9, F.T.A.	ES0347785000	IM.CED.9/4,25 BTA 20160609 GTIA	09/06/2016	4,250	103.037,12
IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS V, F.T.A.	ES0347547004	IM.POP.EMP.V/VAR BTA 20431022 A	22/10/2043	V	58.388,85
IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, F.T.A.	ES0347787006	IM.PREST.F.CED./VAR BTA 20220124 A	24/01/2022	V	36.432,97
INTERMONEY MASTER CEDULAS, F.T.A.	ES0362859003	INTER.MAST.CED/3,50 BTA 20151202 M1	02/12/2015	3,500	101.974,35
KUTXABANK, S.A.	ES0314100068	BBK/4,38 BO 20150928	28/09/2015	4,380	104.502,79
KUTXABANK, S.A.	ES0314100076	BBK/4,40 BO 20160301	01/03/2016	4,400	104.538,59
LIBERBANK, S.A.	ES0314826076	CAJASTUR/4,50 BO 20140224 GTIA	24/02/2014	4,500	50.383,67
MADRID RMBS I, F.T.A.	ES0359091040	MADRID.RMBS.I/VAR BTA 20490622 D	22/06/2049	V	99.863,06
MADRID RMBS II, F.T.A.	ES0359092055	MADRID.RMBS.II/VAR BTA 20490822 D	22/08/2049	V	99.863,06
MAPFRE, S.A.	ES0324244005	MAP/5,125 BO 20151116	16/11/2015	5,125	106.384,89
MBS BANCAJA 4, F.T.A.	ES0361797022	MBS.BANCAJA.4/VAR BTA 20500723 A3	23/07/2050	V	79.268,26
MELIA HOTELS INTERNATIONAL, S.A.	ES0376252005	MEL/7,80 BO 20160731	31/07/2016	7,800	100.52
NCG BANCO, S.A.	ES0314843329	CAIXAGALICIA/3,00 BO 20141103 GTIA	03/11/2014	3,000	50.805,05
NCG BANCO, S.A.	ES0314958069	CAIXANOVA/3,125 BO 20150415 GTIA	15/04/2015	3,125	50.981,65
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622004	PROG.CED.TDA/VAR BTA 20160408 A1	08/04/2016	V	94.482,79
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622012	PROG.CED.TDA/4,13 BTA 20210410 A4	10/04/2021	4,125	97.817,15
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622020	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20310410 A6	10/04/2031	4,250	82.885,57
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622038	PROG.CED.TDA/4,00 BTA 20181023 A5	23/10/2018	4,000	103.313,65
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622046	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20270328 A3	28/03/2027	4,250	85.161,78
PYME BANCAJA 5, F.T.A.	ES0372259038	PYME.BANCAJA.5/VAR BTA 20390214 B	14/02/2039	V	93.350,00
PYMES BANESTO 2, F.T.A.	ES0372260036	PYMES.BTO.2/VAR BTA 20311231 C	31/12/2031	V	18.743,76
RENTA 4 BANCO, S.A.	ES0373358003	R4/5,00 BOCONV 20140328	28/03/2014	5,000	999,81
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, F.T.A.	ES0374273003	RURAL.HIP.GBL.I/VAR BTA 20390118 A	18/01/2039	V	31.245,69
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, F.T.A.	ES0374273011	RURAL.HIP.GBL.I/VAR BTA 20390118 B	18/01/2039	V	67.750,00

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, F.T.A.	ES0374273029	RURAL.HIP.GBL.I/VAR BTA 20390118 C	18/01/2039	V	57.700,00
RURAL HIPOTECARIO III, F.T.H.	ES0358282012	RURAL.HIP.III/VAR BTH 20320313 B	13/03/2032	V	78.800,00
RURAL HIPOTECARIO IX, F.T.A.	ES0374274019	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 A2	17/02/2050	V	41.920,58
RURAL HIPOTECARIO IX, F.T.A.	ES0374274068	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 E	17/02/2050	V	49.536,31
RURAL HIPOTECARIO V, F.T.H.	ES0358284000	RURAL.HIP.V/VAR BTH 20350315 A1	15/03/2035	V	23.796,62
RURAL HIPOTECARIO VI, F.T.A.	ES0374306019	RURAL.HIP.VI/VAR BTA 20361017 B	17/10/2036	V	43.905,19
RURAL HIPOTECARIO VII, F.T.A.	ES0366366005	RURAL.HIP.VII/VAR BTA 20380315 A1	15/03/2038	V	28.030,09
RURAL HIPOTECARIO VIII, F.T.A.	ES0366367011	RURAL.HIP.VIII/VAR BTA 20440119 A2A	19/01/2044	V	40.024,03
RURAL HIPOTECARIO VIII, F.T.A.	ES0366367060	RURAL.HIP.VIII/VAR BTA 20440119 E	19/01/2044	V	49.906,13
RURAL HIPOTECARIO X, F.T.A.	ES0374275016	RURAL.HIP.X/VAR BTA 20530525 B GTIA	25/05/2053	V	99.855,20
RURAL HIPOTECARIO X, F.T.A.	ES0374275024	RURAL.HIP.X/VAR BTA 20530525 C GTIA	25/05/2053	V	99.815,20
RURAL HIPOTECARIO XI, F.T.A.	ES0323975005	RURAL.HIP.XI/VAR BTA 20530325 A	25/03/2053	V	64.478,08
RURAL HIPOTECARIO XI, F.T.A.	ES0323975013	RURAL.HIP.XI/VAR BTA 20530325 B	25/03/2053	V	99.915,88
RURAL HIPOTECARIO XI, F.T.A.	ES0323975021	RURAL.HIP.XI/VAR BTA 20530325 C	25/03/2053	V	99.892,55
RURAL HIPOTECARIO XII, F.T.A.	ES0323976011	RURAL.HIP.XII/VAR BTA 20530622 B	22/06/2053	V	99.911,88
RURAL HIPOTECARIO XII, F.T.A.	ES0323976029	RURAL.HIP.XII/VAR BTA 20530622 C	22/06/2053	V	99.887,43
SOCIEDAD DE GESTION DE ACTIVOS PROC. DE LA REESTR. BANCARIA, S.A.	ES0352506036	SAREB/VAR BO 20140228 2013-1	28/02/2014	V	99.683,99
SOCIEDAD DE GESTION DE ACTIVOS PROC. DE LA REESTR. BANCARIA, S.A.	ES0352506044	SAREB/VAR BO 20150228 2013-2	28/02/2015	V	99.521,30
SOCIEDAD DE GESTION DE ACTIVOS PROC. DE LA REESTR. BANCARIA, S.A.	ES0352506051	SAREB/VAR BO 20160228 2013-3	28/02/2016	V	99.417,34
TDA 12, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0377976024	TDA 12/VAR BTH 20300426 A3 GTIA	26/04/2030	V	6.172,99
TDA 13-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377977022	TDA 13-MIXTO/VAR BTH 20151026 A2	26/10/2015	V	6.021,21
TDA 13-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377977030	TDA 13-MIXTO/VAR BTH 20151026 B2	26/10/2015	V	53.394,39
TDA 14-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377978020	TDA 14-MIXTO/VAR BTH 20310126 A3	26/01/2031	V	13.580,53
TDA 14-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377978046	TDA 14-MIXTO/VAR BTH 20310126 AN	26/01/2031	V	9.023,19
TDA 16-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377973005	TDA.16-MIX/VAR BTA 20350322 A1 GTIA	22/03/2035	V	12.472,72
TDA 18-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377989019	TDA 18-MIXTO/VAR BTA 20450622 A2	22/06/2045	V	12.286,14
TDA 23, F.T.A.	ES0377984002	TDA 23/VAR BTA 20460922 A GTIA	22/09/2046	V	23.724,54
TDA 24, F.T.A.	ES0377952033	TDA.24/VAR BTA 20400622 C GTIA	22/06/2040	V	2.990,08
TDA CAM 1, F.T.A.	ES0338448006	TDA CAM 1/VAR BTA 20320922 A GTIA	22/09/2032	V	15.768,82
TDA CAM 2, F.T.A.	ES0338449004	TDA CAM 2, FTA/VAR BTA 20321026 A	26/10/2032	V	18.257,86
TDA CAM 2, F.T.A.	ES0338449012	TDA CAM 2, FTA/VAR BTA 20321026 B	26/10/2032	V	71.650,00
TDA CAM 3, F.T.A.	ES0377990009	TDA.CAM.3/VAR BTA 20330426 A GTIA	26/04/2033	V	16.882,53
TDA CAM 3, F.T.A.	ES0377990017	TDA.CAM.3/VAR BTA 20330426 B GTIA	26/04/2033	V	65.500,00
TDA CAM 5, F.T.A.	ES0377992005	TDA.CAM.5/VAR BTA 20431026 A GTIA	26/10/2043	V	33.505,94
TDA CAM 6, F.T.A.	ES0377993029	TDA.CAM.6/VAR BTA 20440428 A3 GTIA	28/04/2044	V	42.054,87
TDA CAM 7, F.T.A.	ES0377994027	TDA.CAM.7/VAR BTA 20490226 A3 GTIA	26/02/2049	V	54.337,42
TDA IBERCAJA 1, F.T.A.	ES0338450002	TDA IBERCAJA 1/VAR BTA 20350726 A	26/07/2035	V	21.628,20
TDA IBERCAJA 2, F.T.A.	ES0338451000	TDA IBERCAJA 2/VAR BTA 20421026 A	26/10/2042	V	36.974,92
TDA IBERCAJA 3, F.T.A.	ES0338452008	TDA.IBERCAJA.3/VAR BTA 20431228 A	28/12/2043	V	36.761,89
TDA IBERCAJA 4, F.T.A.	ES0338453014	TDA.IBERCAJA.4/VAR BTA 20440826 A2	26/08/2044	V	46.551,09
TDA IBERCAJA 5, F.T.A.	ES0377967015	TDA IBERCAJA.5/VAR BTA 20491126 A2	26/11/2049	V	50.723,37
VALENCIA HIPOTECARIO 2, F.T.H.	ES0382745000	VALENCIA.HIP.2/VAR BTH 20430124 A	24/01/2043	V	31.555,56
VALENCIA HIPOTECARIO 3, F.T.A.	ES0382746016	VALENCIA.HIP.3/VAR BTA 20440922 A2	22/09/2044	V	44.148,12
ZINKIA ENTERTAINMENT, S.A.	ES0384849008	ZNK/11,00 BO 20151112	12/11/2015	11,000	878,05

CÉDULAS

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211055	BBVA/4,25 CEDHIP 20140715 GTIA	15/07/2014	4,250	102.169,28
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211071	BBVA/4,00 CEDHIP 20250225 GTIA	25/02/2025	4,000	107.681,85
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211089	BBVA/3,50 CEDHIP 20150225 GTIA	25/02/2015	3,500	103.254,39
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211105	BBVA/3,50 CEDHIP 20201007 GTIA	07/10/2020	3,500	105.807,66
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211113	BBVA/3,25 CEDHIP 20160124 GTIA	24/01/2016	3,250	104.242,07
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211121	BBVA/3,50 CEDHIP 20210124 GTIA	24/01/2021	3,500	106.821,76
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211170	BBVA/4,25 CEDHIP 20170118 GTIA	18/01/2017	4,250	108.241,53
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211204	BBVA/4,50 CEDTER 20140530 GTIA	30/05/2014	4,500	51.131,47
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211337	BBVA/3,00 CEDHIP 20141009 GTIA	09/10/2014	3,000	50.979,32
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211345	BBVA/3,625 CEDHIP 20170118 GTIA	18/01/2017	3,625	53.344,15
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211378	BBVA/VAR CEDHIP 20140728 GTIA	28/07/2014	V	49.689,15
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211410	BBVA/4,125 CEDHIP 20140113 GTIA	13/01/2014	4,125	50.230,27
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211428	BBVA/4,75 CEDHIP 20160210 GTIA	10/02/2016	4,750	53.842,03
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211469	BBVA/4,25 CEDHIP 20150330 GTIA	30/03/2015	4,250	52.181,77
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211782	BBVA/3,50 CEDHIP 20171205 GTIA	05/12/2017	3,500	106.531,87
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211790	BBVA/3,875 CEDHIP 20230130 GTIA	30/01/2023	3,875	107.867,44
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211808	BBVA/VAR CEDTER 20161204 GTIA	04/12/2016	V	100.000,00
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA, S.A.	ES0415474305	CA.ESPAÑA/3,00 CEDHIP 20150603 GTIA	03/06/2015	3,000	998,50
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA, S.A.	ES0458673011	CA.ESP.DUERO/VAR CEDHIP 20140630	30/06/2014	V	1.014,40
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA, S.A.	ES0458673037	CA.ESP.DUERO/4,25 CEDHIP 20150430	30/04/2015	4,250	50.367,76
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860026	SAB/3,25 CEDHIP 20150615 GTIA	15/06/2015	3,250	102.992,70
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860034	SAB/3,50 CEDHIP 20160119 GTIA	19/01/2016	3,500	103.987,57
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860067	SAB/4,25 CEDHIP 20170124 GTIA	24/01/2017	4,250	107.099,96
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860182	SAB/3,125 CEDHIP 20140120 GTIA	20/01/2014	3,125	100.604,74
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860281	SAB/3,625 CEDHIP 20150216 GTIA	16/02/2015	3,625	102.914,60
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860299	SAB/4,25 CEDHIP 20140919 GTIA	19/09/2014	4,250	102.623,24
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860323	SAB/3,375 CEDHIP 20180123 GTIA	23/01/2018	3,375	103.581,85
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0414400079	CAM/3,375 CEDHIP 20141022 GTIA	22/10/2014	3,375	50.988,98
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413770001	PAS/3,75 CEDHIP 20150304 GTIA	04/03/2015	3,750	102.806,53
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413770092	PAS/3,25 CEDHIP 20140317 GTIA	17/03/2014	3,250	100.618,55
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790017	POP/4,00 CEDHIP 20161018 GTIA	18/10/2016	4,000	104.651,54
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790058	POP/4,375 CEDHIP 20140616 GTIA	16/06/2014	4,375	50.840,28
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790074	POP/4,125 CEDHIP 20180409 GTIA	09/04/2018	4,125	52.947,41
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790116	POP/4,25 CEDHIP 20150930 GTIA	30/09/2015	4,250	52.152,39
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790173	POP/4,125 CEDHIP 20170330 GTIA	30/03/2017	4,125	106.062,13
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790231	POP/3,75 CEDHIP 20190122 GTIA	22/01/2019	3,750	103.891,39
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790314	POP/3,50 CEDHIP 20170911 GTIA	11/09/2017	3,500	103.104,89
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440027	BTO/5,75 CEDHIP 20170327 GTIA	27/03/2017	5,750	113.715,07
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440050	BTO/4,25 CEDHIP 20140916 GTIA	16/09/2014	4,250	102.915,21
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440068	BTO/3,50 CEDHIP 20150127 GTIA	27/01/2015	3,500	102.958,43
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440084	BTO/3,50 CEDHIP 20160118 GTIA	18/01/2016	3,500	104.649,75
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440100	BTO/4,25 CEDHIP 20140221 GTIA	21/02/2014	4,250	101.188,14
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440175	BTO/3,625 CEDHIP 20150907 GTIA	07/09/2015	3,625	104.383,77
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440217	BTO/4,625 CEDHIP 20150330 GTIA	30/03/2015	4,625	104.783,64
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440266	BTO/3,75 CEDHIP 20160617 GTIA	17/06/2016	3,750	106.091,33
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440308	BTO/4,75 CEDHIP 20170124 GTIA	24/01/2017	4,750	109.831,21
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900061	SAN/4,50 CEDHIP 20160729 GTIA	29/07/2016	4,500	108.040,68
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900087	SAN/4,00 CEDHIP 20200407 GTIA	07/04/2020	4,000	108.020,17
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900103	SAN/3,125 CEDHIP 20150928 GTIA	28/09/2015	3,125	103.351,83
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900111	SAN/3,50 CEDHIP 20140206 GTIA	06/02/2014	3,500	100.698,83
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900129	SAN/3,875 CEDHIP 20260206 GTIA	06/02/2026	3,875	106.627,78
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900145	SAN/4,125 CEDHIP 20170109 GTIA	09/01/2017	4,125	108.081,04
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900160	SAN/4,625 CEDHIP 20270504 GTIA	04/05/2027	4,625	113.614,22
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900186	SAN/3,875 CEDHIP 20140527 GTIA	27/05/2014	3,875	101.646,93
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900202	SAN/3,125 CEDHIP 20150128 GTIA	28/01/2015	3,125	102.544,52
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900210	SAN/3,625 CEDHIP 20170406 GTIA	06/04/2017	3,625	106.764,24
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900228	SAN/4,625 CEDHIP 20160120 GTIA	20/01/2016	4,625	107.008,66
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900244	SAN/4,375 CEDHIP 20150316 GTIA	16/03/2015	4,375	104.545,11
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900251	SAN/4,625 CEDTER 20160621 GTIA	21/06/2016	4,625	107.979,66
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900285	SAN/3,25 CEDHIP 20150217 GTIA	17/02/2015	3,250	102.835,26
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900327	SAN/2,875 CEDHIP 20180130 GTIA	30/01/2018	2,875	103.802,88
BANKIA, S.A.	ES0413307028	BKIA/4,00 CEDHIP 20140228 GTIA	28/02/2014	4,000	50.358,46
BANKIA, S.A.	ES0414950560	CA.MADRID/5,75 CEDHIP 20160629 GTIA	29/06/2016	5,750	108.829,83
BANKIA, S.A.	ES0414950594	CA.MADRID/5,00 CEDHIP 20141030 GTIA	30/10/2014	5,000	103.399,89
BANKIA, S.A.	ES0414950628	CA.MADRID/4,00 CEDHIP 20250203 GTIA	03/02/2025	4,000	95.018,34
BANKIA, S.A.	ES0414950636	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20151214 GTIA	14/12/2015	3,500	103.001,87
BANKIA, S.A.	ES0414950644	CA.MADRID/4,125 CEDHIP 20360324	24/03/2036	4,125	42.078,94
BANKIA, S.A.	ES0414950651	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20180525 GTIA	25/05/2018	4,250	52.841,79
BANKIA, S.A.	ES0414950669	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20160705 GTIA	05/07/2016	4,250	52.368,17
BANKIA, S.A.	ES0414950677	CA.MADRID/4,25 CEDTER 20140221 GTIA	21/02/2014	4,250	50.315,89
BANKIA, S.A.	ES0414950685	CA.MADRID/4,50 CEDHIP 20220426 GTIA	26/04/2022	4,500	49.493,27
BANKIA, S.A.	ES0414950693	CA.MADRID/5,00 CEDHIP 20190628 GTIA	28/06/2019	5,000	54.220,68
BANKIA, S.A.	ES0414950776	CA.MADRID/3,625 CEDHIP 20161005	05/10/2016	3,625	51.773,81
BANKIA, S.A.	ES0414950784	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20141113 GTIA	13/11/2014	3,500	51.018,91

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
BANKIA, S.A.	ES0414950842	CA.MADRID/4,875 CEDHIP 20140331	31/03/2014	4,875	50.591,73
BANKIA, S.A.	ES0414977258	BANCAJA/4,375 CEDHIP 20150128 GTIA	28/01/2015	4,375	103.125,00
BANKINTER, S.A.	ES0413679061	BKT/3,25 CEDHIP 20141113 GTIA	13/11/2014	3,250	102.306,48
BANKINTER, S.A.	ES0413679103	BKT/3,90 CEDHIP 20140114 GTIA	14/01/2014	3,900	100.390,00
BANKINTER, S.A.	ES0413679178	BKT/4,125 CEDHIP 20170322 GTIA	22/03/2017	4,125	54.081,76
BANKINTER, S.A.	ES0413679202	BKT/3,875 CEDHIP 20151030 GTIA	30/10/2015	3,875	52.481,85
BANKINTER, S.A.	ES0413679269	BKT/2,75 CEDHIP 20160726 GTIA	26/07/2016	2,750	102.971,61
CAIXABANK, S.A.	ES0414970196	LACAIXA/4,75 CEDHIP 20181031 GTIA	31/10/2018	4,750	112.293,85
CAIXABANK, S.A.	ES0414970204	LACAIXA/3,875 CEDHIP 20250217 GTIA	17/02/2025	3,875	100.258,79
CAIXABANK, S.A.	ES0414970212	LACAIXA/3,25 CEDHIP 20151005 GTIA	05/10/2015	3,250	103.821,65
CAIXABANK, S.A.	ES0414970238	LACAIXA/3,375 CEDHIP 20140630 GTIA	30/06/2014	3,375	50.790,43
CAIXABANK, S.A.	ES0414970246	LACAIXA/3,625 CEDHIP 20210118 GTIA	18/01/2021	3,625	52.738,14
CAIXABANK, S.A.	ES0414970253	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160630 GTIA	30/06/2016	V	952,09
CAIXABANK, S.A.	ES0414970261	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160616 GTIA	16/06/2016	V	97.078,27
CAIXABANK, S.A.	ES0414970295	LACAIXA/4,25 CEDHIP 20170126 GTIA	26/01/2017	4,250	54.141,00
CAIXABANK, S.A.	ES0414970337	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160930 GTIA	30/09/2016	V	947,76
CAIXABANK, S.A.	ES0414970352	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170330 GTIA	30/03/2017	V	943,76
CAIXABANK, S.A.	ES0414970378	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170320 GTIA	20/03/2017	V	48.475,00
CAIXABANK, S.A.	ES0414970394	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170930 GTIA	30/09/2017	V	934,33
CAIXABANK, S.A.	ES0414970402	LACAIXA/4,625 CEDHIP 20190604 GTIA	04/06/2019	4,625	56.018,92
CAIXABANK, S.A.	ES0414970519	LACAIXA/3,75 CEDHIP 20140526 GTIA	26/05/2014	3,750	50.811,99
CAIXABANK, S.A.	ES0414970535	LACAIXA/3,50 CEDHIP 20160331 GTIA	31/03/2016	3,500	52.460,97
CAIXABANK, S.A.	ES0414970576	LACAIXA/3,50 CEDHIP 20150430 GTIA	30/04/2015	3,500	51.470,00
CAIXABANK, S.A.	ES0414970634	LACAIXA/4,706 CEDHIP 20140131 GTIA	31/01/2014	4,706	50.332,83
CAIXABANK, S.A.	ES0414970659	LACAIXA/5,00 CEDHIP 20160222 GTIA	22/02/2016	5,000	53.941,07
CAIXABANK, S.A.	ES0414970667	LACAIXA/4,75 CEDHIP 20150318 GTIA	18/03/2015	4,750	52.426,79
CAIXABANK, S.A.	ES0414970683	LACAIXA/5,125 CEDHIP 20160427 GTIA	27/04/2016	5,125	54.407,54
CAIXABANK, S.A.	ES0440609040	CABK/4,00 CEDHIP 20170216 GTIA	16/02/2017	4,000	107.819,88
CAIXABANK, S.A.	ES0440609206	CABK/3,00 CEDHIP 20180322 GTIA	22/03/2018	3,000	103.980,74
CAJA RURAL DE GRANADA, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0415143009	CR.GRANADA/3,00 CEDHIP 20181216	16/12/2018	3,000	100.000,00
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0415306002	CR.NAVARRA/2,875 CEDHIP 20180611	11/06/2018	2,875	101.712,74
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0415306010	CR.NAVARRA/3,00 CEDHIP 20201127	27/11/2020	3,000	100.000,00
CAJAS RURALES UNIDAS, SOCIEDAD COOP. DE CREDITO	ES0414601023	CAJAMAR/3,50 CEDHIP 20141023 GTIA	23/10/2014	3,500	101.380,20
CAJAS RURALES UNIDAS, SOCIEDAD COOP. DE CREDITO	ES0422714016	CRU/3,375 CEDHIP 20160516 GTIA	16/05/2016	3,375	101.099,05
CAJAS RURALES UNIDAS, SOCIEDAD COOP. DE CREDITO	ES0422714024	CRU/3,75 CEDHIP 20181122 GTIA	22/11/2018	3,750	99.685,38
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0414840274	CA.CATALUNYA/3,50 CEDHIP 20160307	07/03/2016	3,500	101.002,40
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0414840308	CA.CATALUNYA/4,875 CEDHIP 20170629	29/06/2017	4,875	103.565,03
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0414954141	IBERCAJA/3,375 CEDHIP 20141127 GTIA	27/11/2014	3,375	51.089,06
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0414954166	IBERCAJA/3,50 CEDHIP 20150422 GTIA	22/04/2015	3,500	51.065,39
KUTXABANK, S.A.	ES0414100026	BBK/3,375 CEDHIP 20140929 GTIA	29/09/2014	3,375	102.168,57
KUTXABANK, S.A.	ES0415309006	KUTXA/4,375 CEDHIP 20141105 GTIA	05/11/2014	4,375	51.727,43
KUTXABANK, S.A.	ES0415309014	KUTXA/5,125 CEDHIP 20150408 GTIA	08/04/2015	5,125	52.808,60
KUTXABANK, S.A.	ES0415309030	KUTXA/VAR CEDHIP 20151109 GTIA	09/11/2015	V	101.999,62
KUTXABANK, S.A.	ES0443307014	KUTXABANK/3,00 CEDHIP 20170201 GTIA	01/02/2017	3,000	104.185,86
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0413495005	SAN.CONS.FIN/3,875 CEDHIP 20160323	23/03/2016	3,875	105.423,48
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0458759000	UNICAJA/4,375 CEDHIP 20151014 GTIA	14/10/2015	4,375	52.103,41
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0458759034	UNICAJA/5,50 CEDHIP 20160323 GTIA	23/03/2016	5,500	53.974,07
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0464872060	UNICAJA/3,125 CEDHIP 20141006 GTIA	06/10/2014	3,125	50.775,19

PAGARÉS

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
BANCA MARCH, S.A.	ES0513045GN5	BCA.MARCH/PAG 20140103	03/01/2014	C	996,94
BANCA MARCH, S.A.	ES0513045JB4	BCA.MARCH/PAG 20141016	16/10/2014	C	971,94
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138623Y4	SAB/PAG 20140129	29/01/2014	C	993,12
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806OK0	POP/PAG 20151016	16/10/2015	C	932,91
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900UJ0	SAN/PAG 20140107	07/01/2014	C	998,68
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900UT9	SAN/PAG 20140109	09/01/2014	C	997,80
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900UW3	SAN/PAG 20140128	28/01/2014	C	997,52
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900UZ6	SAN/PAG 20140121	21/01/2014	C	996,11
BANKINTER, S.A.	ES0513679YC7	BKT/PAG 20140611	11/06/2014	C	985,10
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688H53	BBVAF/PAG 20140106	06/01/2014	C	997,87
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688J69	BBVAF/PAG 20140117	17/01/2014	C	996,85
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688J85	BBVAF/PAG 20140115	15/01/2014	C	997,69
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688K90	BBVAF/PAG 20140103	03/01/2014	C	996,89
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688L65	BBVAF/PAG 20140107	07/01/2014	C	998,26
LIBERBANK, S.A.	ES0568675377	LIBERBANK/PAG 20140221	21/02/2014	C	9.926,98
LIBERBANK, S.A.	ES0568675492	LIBERBANK/PAG 20140523	23/05/2014	C	9.871,58

PARTICIPACIONES PREFERENTES

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0113860003	SAB/VAR NACU AMTB PPR		V	780,91
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0113440004	BTO/VAR NACU AMTB PPR 1		V	765,29
BANKINTER EMISIONES, S.A.U.	ES0113549002	BKT.EM/VAR NACU AMTB PPR I		V	38,91
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224001	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	94,68
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224027	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR B		V	94,18
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224043	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR C		V	96,02
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224050	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR D		V	96,21
BBVA INTERNATIONAL LIMITED	KYG090001119	BBVA.INTL/VAR NACU AMTB PPR F		V	90,17
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL LTD.	KYG717151099	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	749,62
CAIXA PREFERENCE, S.A.	KYG175471039	CAIXA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	520,43
CAIXA PREFERENCE, S.A.	KYG175471112	CAIXA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	506,13
CAIXA TERRASSA, SOCIETAT DE PARTICIPATIONS PREFERENTS, S.A.U.	KYG175491094	TERRASSA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	800,38
CAIXABANK, S.A.	ES0113249025	CA.GIRONA/VAR NACU AMTB PPR		V	50.471,61
CAIXABANK, S.A.	ES0114970009	LACAIXA/VAR NACU AMTB PPR I		V	765,42
CAIXABANK, S.A.	ES0115009005	CAJACANARIAS/VAR NACU AMTB PPR		V	958,35
CAIXABANK, S.A.	ES0848873008	BCIV/VAR NACU AMTB PPR		V	1.011,87
CAIXASABADELL PREFERENTS, S.A.U.	ES0101339002	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	800,00
CAIXASABADELL PREFERENTS, S.A.U.	ES0101339028	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	31.409,04
CAM CAPITAL, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0114607007	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR C		V	918,41
CAM CAPITAL, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	KYG1793R1103	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	509,05
DEOLEO PREFERENTES, S.A.U.	ES0130124003	DEOLEO.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	24.976,83
EL MONTE CAPITAL, S.A.U.	KYG3014M1024	MONTE.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	207,50
EL MONTE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	ES0128469022	EL.MONTE.PREF/VAR NACU AMTB PPR D		V	500,00
GUIPUZCOANO CAPITAL, S.A.	ES0143561001	GUI.CAP/VAR NACU AMTB PPR I		V	49,00
GUIPUZCOANO CAPITAL, S.A.	ES0143561043	GUI.CAP/VAR NACU AMTB PPR III		V	95,61
POPULAR CAPITAL, S.A.	ES0170412003	POP.CAP./VAR NACU AMTB PPR D		V	73,17
REPSOL INTERNATIONAL CAPITAL LTD.	KYG7513K1379	REP.INTL.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	842,53
REPSOL INTERNATIONAL CAPITAL LTD.	KYG7513K1452	REP.INTL.CAP/VAR NACU AMTB PPR C		V	851,48
SABADELL INTERNATIONAL EQUITY, LTD	KYG773751063	SAB.INTL.EQ/VAR NACU AMTB PPR A		V	238,55
SANTANDER FINANCE CAPITAL, S.A.U.	ES0175179078	SAN.FIN.CAP/VAR NACU AMTB PPR X		V	16,55
SOL MELIA FINANCE LIMITED	KYG8259W1033	SOL.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	92,53
TELEFONICA FINANCE USA, L.L.C.	USU87942AA33	TEF.FIN.USA/VAR NACU AMTB PPR		V	888,72
UNION FENOSA FINANCIAL SERVICES USA, L.L.C.	USU90716AA64	UNF.FINL.USA/VAR NACU AMTB PPR		V	22,54

RENTA VARIABLE

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Valor Medio en Euros
1NKEMIA IUCT GROUP, S.A.	ES0156303002	1NKEMIA.IUCT/AC 0,10	1,01
AB-BIOTICS, S.A.	ES0109659013	AB-BIOTICS/AC 0,05	1,92
ABENGOA, S.A.	ES0105200002	ABG/AC B 0,01	1,90
ABENGOA, S.A.	ES0105200416	ABG/AC A 1,00	2,36
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0111845014	ABE/AC 3,00	15,48
ACCIONA, S.A.	ES0125220311	ANA/AC 1,00	43,67
ACERINOX, S.A.	ES0132105018	ACX/AC 0,25	9,36
ACS, ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS, S.A.	ES0167050915	ACS/AC 0,50	23,81
ADOLFO DOMINGUEZ, S.A.	ES0106000013	ADZ/AC 0,60	5,63
ADVEO GROUP INTERNATIONAL, S.A.	ES0182045312	ADV/AC 1,50	13,76
AGROFRUSE-MEDITERRANEAN AGRICULTURAL GROUP, S.A.	ES0106325014	AGROFRUSE/AC 3,01	7,26
AGUAS DE SABADELL, CIA., S.A.	ES0107350011	AGUAS.SAB/AC B 12,02	54,95
AHORRO FAMILIAR, S.A.	ES0107511018	AH.FAMILIAR/AC 6,00	6,15
AIRBUS GROUP, N.V.	NL0000235190	AC. AIRBUS	51,42
ALFA, S.A.B. DE C.V.	MXFP000511016	AC. ALFA S/A	2,05
ALMIRALL, S.A.	ES0157097017	ALM/AC 0,12	10,94
ALTIA CONSULTORES, S.A.	ES0113312005	ALTIA.CONSULT/AC 0,02	3,93
AMADEUS IT HOLDING, S.A.	ES0109067019	AMS/AC A 0,01	27,43
AMERICA MOVIL, S.A.B. DE C.V.	MXP001691213	AC. AMERICA MOVIL. S/L	0,80
AMPER, S.A.	ES0109260531	AMP/AC 1,00	1,19
APERAM SOCIETE ANONYME	LU0569974404	APAM/AC SVN	12,59
ARCELORMITTAL, S.A.	LU0323134006	ARCELORMITTAL/AC SVN	11,94
ATRESMEDIA CORPORACION DE MEDIOS DE COMUNICACION, S.A.	ES0109427734	A3M/AC A 0,75	11,19
AYCO GRUPO INMOBILIARIO, S.A.	ES0152960011	AYCO.GRP.INMO/AC 3,01	5,22
AZKOYEN, S.A.	ES0112458312	AZK/AC 0,60	1,96
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0113211835	BBVA/AC 0,49	8,64
BANCO BRADESCO, S.A.	BRBBDACACNPR8	AC. BANCO BRADESCO -PREF.-	10,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0113860A34	SAB/AC 0,125	1,84
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0113790226	POP/AC 0,50	4,15
BANCO SANTANDER RIO, S.A.	ARBRI0010194	AC. BCO SANTANDER RIO. S/B	1,40
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0113900J37	SAN/AC 0,50	6,41
BANKIA, S.A.	ES0113307021	BKIA/AC 1,00	1,03
BANKINTER, S.A.	ES0113679137	BKT/AC 0,30	4,53
BARON DE LEY, S.A.	ES0114297015	BDL/AC 0,60	59,42
BAYER A.G.	DE000BAY0017	AC. BAYER	93,60
BBVA BANCO FRANCES, S.A.	ARF125991090	AC. BBVA BCO. FRANCES	2,22
BIOORGANIC RESEARCH AND SERVICES, S.A.	ES0184980003	BNT/AC 0,05	3,12
BIOSEARCH, S.A.	ES0172233118	BIO/AC 0,24	0,57
BODACLICK, S.A.	ES0171957014	BODACLICK/AC 0,02	0,52
BODEGAS BILBAINAS, S.A.	ES0114930011	BODEGAS.BILB/AC 6,01	6,55
BODEGAS RIOJANAS, S.A.	ES0115002018	RIO/AC 0,75	4,97
BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOLES, SDAD HOLDING DE MDOS Y STMAS FIN., S.A.	ES0115056139	BME/AC 3,00	26,53
BRADESPAR, S.A.	BRBRAPACNOR5	AC. BRADESPAR	6,73
BRADESPAR, S.A.	BRBRAPACNPR2	AC. BRADESPAR -PREF.-	8,18
BRASKEM, S.A.	BRBRKMACNPA4	AC. BRASKEM -PREF.-	6,24
CAIXABANK, S.A.	ES0140609019	CABK/AC 1,00	3,66
CAMPOFRIO FOOD GROUP, S.A.	ES0121501318	CFG/AC 1,00	6,48
CARBURES EUROPE, S.A.	ES0116162001	CARBURES/AC 0,68	10,42
CARTERA INDUSTRIAL REA, S.A.	ES0162292017	CART.IND.REA/AC 2,30	1,85
CATENON, S.A.	ES0112320009	CATENON/AC 0,02	1,10
CEMENTOS MOLINS, S.A.	ES0117360117	CEMENTOS.MOLINS/AC 0,30	7,49
CEMENTOS PORTLAND VALDERRIVAS, S.A.	ES0117390411	CPL/AC 1,50	6,36
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNOR6	AC. ELETROBRAS	2,08
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNPB7	AC. ELETROBRAS. PREF. S/B	3,53
CIE AUTOMOTIVE, S.A.	ES0105630315	CIE/AC 0,25	7,72
CLINICA BAVIERA, S.A.	ES0119037010	CBAV/AC 0,10	9,40
CODERE, S.A.	ES0119256115	CDR/AC 0,20	1,35
COMMCENTER, S.A.	ES0121071007	COMMCENTER/AC 0,50	2,73
COMPANHIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	BRCMIGACNPR3	AC. CEMIG -PREF.-	6,26
COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	BRCPLEACNPB9	AC. COPEL -PREF.-	10,07
CONSTRUCCIONES Y AUXILIAR DE FERROCARRILES, S.A.	ES0121975017	CAF/AC 3,01	381,89
CORPORACION FINANCIERA ALBA, S.A.	ES0117160111	ALB/AC 1,00	42,43
DEOLEO, S.A.	ES0110047919	OLE/AC 0,50	0,45
DINAMIA CAPITAL PRIVADO, SCR, S.A.	ES0126501131	DIN/AC 3,00	6,61
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION, S.A.	ES0126775032	DIA/AC 0,10	6,55
DURO FELGUERA, S.A.	ES0162600417	MDF/AC 0,50	4,84
EBIOSS ENERGY, A.D.	BG1100025128	EBIOSS ENERGY/AC 5,00	8,34
EBRO FOODS, S.A.	ES0112501012	EBRO/AC 0,60	16,82
ELECNOR, S.A.	ES0129743318	ENO/AC 0,10	10,55
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD, S.A.	CLP3710M1090	AC. ENDESA CHILE	1,04
ENAGAS, S.A.	ES0130960018	ENG/AC 1,50	19,06
ENCE ENERGIA Y CELULOSA, S.A.	ES0130625512	ENC/AC 0,90	2,88
ENDESA, S.A.	ES0130670112	ELE/AC 1,20	21,15

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Valor Medio en Euros
ENEL GREEN POWER, S.P.A.	IT0004618465	EGPW/AC 0,20	1,74
ENERSIS, S.A.	CLP371861061	AC. ENERSIS	0,23
ENTRECAMPOS CUATRO, SOCIMI, S.A.	ES0131172001	ENTRECAMPOS 4/AC 1,00	2,12
ERCROS, S.A.	ES0125140A14	ECR/AC 0,30	0,53
ESPAÑOLA DE VIVIENDAS EN ALQUILER, CIA., S.A.	ES0132955016	CEVASA/AC 6,00	149,50
EUROESPES, S.A.	ES0133421000	EUROESPES/AC 0,601012	0,41
EURONA WIRELESS TELECOM, S.A.	ES0133443004	EURONA.WIRELESS/AC 1,00	1,96
FAES FARMA, S.A.	ES0134950F36	FAE/AC 0,10	2,68
FERROVIAL, S.A.	ES0118900010	FER/AC 0,20	13,74
FERSA ENERGÍAS RENOVABLES, S.A.	ES0136463017	FRS/AC 1,00	0,42
FLUIDRA, S.A.	ES0137650018	FDR/AC 1,00	2,44
FOMENTO DE CONSTRUCCIONES Y CONTRATAS, S.A.	ES0122060314	FCC/AC 1,00	15,60
FUNESPAÑA, S.A.	ES0140441017	FUN/AC 0,30	6,14
GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA, S.A.	ES0143416115	GAM/AC 0,17	7,11
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0116870314	GAS/AC 1,00	17,57
GENERAL DE ALQUILER DE MAQUINARIA, S.A.	ES0141571119	GALQ/AC 1,00	0,66
GERDAU, S.A.	BRGGBRACNPR8	AC. GERDAU -PREF.-	5,85
GRIFOLS, S.A.	ES0171996004	GRF/ACSVT B 0,10	23,59
GRIFOLS, S.A.	ES0171996012	GRF/AC A 0,50	31,55
GRIÑO ECOLOGIC, S.A.	ES0143328005	GRIÑO ECOLOGIC/AC 0,02	1,55
GRUPO CATALANA OCCIDENTE, S.A.	ES0116920333	GCO/AC 0,30	24,79
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA, S.A.	COT13PA00011	AC. GRUPOSURA	13,90
GRUPO ELEKTRA, S.A. DE C.V.	MX01EL000003	AC. GRUPO ELEKTRA	25,51
GRUPO EMPRESARIAL SAN JOSE, S.A.	ES0180918015	GSJ/AC 0,03	1,31
GRUPO EZENTIS, S.A.	ES0172708234	EZE/AC 0,60	1,60
GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	MXP370711014	AC. BANORTE S/O	4,85
GRUPO MODELO, S.A.B. DE C.V.	MXP4833F1044	AC. GRUPO MODELO. S/C	6,70
GRUPO TAVEX, S.A.	ES0108180219	TVX/AC 0,92	0,27
IBERDROLA, S.A.	ES0144580Y14	IBE/AC 0,75	4,56
IBERPAPEL GESTION, S.A.	ES0147561015	IBG/AC 0,60	15,12
IMAGINARIUM, S.A.	ES0147791018	IMAGINARIUM/AC 0,03	1,44
INDRA SISTEMAS, S.A.	ES0118594417	IDR/AC A 0,20	11,50
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL, S.A.	ES0148396015	ITX/AC 0,15	115,95
INMOBILIARIA COLONIAL, S.A.	ES0139140042	COL/AC 1,00	1,21
INMOBILIARIA DEL SUR, S.A.	ES0154653911	ISUR/AC 2,00	7,15
INMOLEVANTE, S.A.	ES0154949012	INMOLEVANTE/AC 3,00	9,96
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP, S.A.	ES0177542018	IAG/AC 0,50	4,32
INVERFIATC, S.A.	ES0143419317	INVERFIATC/AC 1,00	0,36
INYPSA INFORMES Y PROYECTOS, S.A.	ES0152768612	INY/AC 0,50	1,05
JAZZTEL, PLC.	GB00B5TMS2P1	JAZ/AC 0,80	7,94
LABORATORIOS FARMACEUTICOS ROVI, S.A.	ES0157261019	ROVI/AC 0,06	9,13
LET'S GOWEX, S.A.	ES0158252033	LET'S.GOWEX/AC 0,01	10,73
LIBERBANK, S.A.	ES0168675009	LBK/AC 0,30	0,61
LIBERTAS 7, S.A.	ES0137998A12	LIBERTAS.7/AC 0,50	2,35
LINGOTES ESPECIALES, S.A.	ES0158480311	LGT/AC 1,00	3,05
LOGÍSTICA DE HIDROCARBUROS CLH, CIA., S.A.	ES0110480219	CLH/AC D 1,20	26,34
MAPFRE, S.A.	ES0124244E34	MAP/AC 0,10	2,89
MEDCOM TECH, S.A.	ES0161857018	MEDCOM.TECH/AC 0,01	3,70
MEDIASET ESPAÑA COMUNICACION, S.A.	ES0152503035	TL5/AC 0,50	8,67
MELIA HOTELS INTERNATIONAL, S.A.	ES0176252718	MEL/AC 0,20	8,38
MIQUEL Y COSTAS & MIQUEL, S.A.	ES0164180012	MCM/AC 2,00	28,68
MOBILIARIA MONESA, S.A.	ES0164228019	MOB.MONESA/AC 3,01	4,32
MONTEBALITO, S.A.	ES0116494016	MTB/AC 1,00	1,11
NATRA, S.A.	ES0165515117	NAT/AC 1,20	2,22
NATRACEUTICAL, S.A.	ES0165359011	NTC/AC 0,10	0,29
NET SERVIÇOS DE COMUNICAÇÃO, S.A.	BRNETCACNPR3	AC. NET SERVIÇOS DE COMUNICAÇÃO -PR	9,53
NEURON BIOPHARMA, S.A.	ES0166198012	NEURON.BIOPH/AC 1,00	1,59
NH HOTELES, S.A.	ES0161560018	NHH/AC 2,00	4,04
NICOLAS CORREA, S.A.	ES0166300212	NEA/AC 0,80	1,36
OBRASCON HUARTE LAIN, S.A.	ES0142090317	OHL/AC 0,60	29,15
PAPELES Y CARTONES DE EUROPA, S.A.	ES0168561019	PAC/AC 2,00	3,88
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNOR9	AC. PETROBRAS	5,74
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNPR6	AC. PETROBRAS -PREF.-	6,07
PRIM, S.A.	ES0170884417	PRM/AC 0,25	5,64
PROMOCIONES RENTA Y MANTENIMIENTO, SOCIMI, S.A.	ES0171613005	PROMORENT/AC 2,00	1,46
PROMOTORA DE INFORMACIONES, S.A.	ES0171743042	PRS/ACSVT CONV B 0,10	0,46
PROMOTORA DE INFORMACIONES, S.A.	ES0171743117	PRS/AC A 0,10	0,37
PROSEGUR, CIA. DE SEGURIDAD, S.A.	ES0175438003	PSG/AC 0,06	4,47
QUABIT INMOBILIARIA, S.A.	ES0110944016	QBT/AC 0,01	0,13
REALIA BUSINESS, S.A.	ES0173908015	RLIA/AC 0,24	0,83
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0173093115	REE/AC 2,00	45,77
RENO DE MEDICI, S.P.A.	IT0001178299	AC. RENO DE MEDICI. S/A	0,27
RENTA 4 BANCO, S.A.	ES0173358039	R4/AC 0,45	4,70
REPSOL, S.A.	ES0173516115	REP/AC 1,00	18,73
RONSA, S.A.	ES0174300014	RONSA/AC 60,10	49,00
SACYR, S.A.	ES0182870214	SYV/AC 1,00	3,82
SARE, S.A.B., DE C.V.	MX01SA030007	AC. SARE. S/B	0,03

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Valor Medio en Euros
SECUOYA GRUPO DE COMUNICACION, S.A.	ES0131703003	SECUOYA.COM/AC 0,0125	3,64
SERVICE POINT SOLUTIONS, S.A.	ES0143421G11	SPS/AC 0,60	0,18
SOCIEDAD ANONIMA DAMM	ES0125690513	DAMM/AC 0,20	4,76
SOLARIA ENERGIA Y MEDIO AMBIENTE, S.A.	ES0165386014	SLR/AC 0,01	0,81
SOTOGRADE, S.A.	ES0138109014	STG/AC 0,60	2,73
SUAVITAS, S.A.	ES0176406009	SUAVITAS/AC 0,01	0,05
TECNICAS REUNIDAS, S.A.	ES0178165017	TRE/AC 0,10	37,74
TECNOCOM, TELECOMUNICACIONES Y ENERGIA, S.A.	ES0147582B12	TEC/AC 0,50	1,32
TELEFONICA, S.A.	ES0178430E18	TEF/AC 1,00	12,17
TESTA INMUEBLES EN RENTA, S.A.	ES0170885018	TST/AC 6,00	7,71
TUBACEX, S.A.	ES0132945017	TUB/AC 0,45	2,88
TUBOS REUNIDOS, S.A.	ES0180850416	TRG/AC 0,10	1,78
TV AZTECA, S.A. DE C.V.	MX01AZ060013	AC. TV AZTECA	0,39
UNION EUROPEA DE INVERSIONES, S.A.	ES0181480114	U.EUROPEA.INV/AC 1,00	3,62
URALITA, S.A.	ES0182170615	URA/AC 0,72	1,41
URBAR INGENIEROS, S.A.	ES0182484214	URBAR.ING/AC 0,50	0,74
URBAS GRUPO FINANCIERO, S.A.	ES0182280018	URBAS/AC 0,01	0,03
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNOR3	AC. USIMINAS	3,74
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNPA6	AC. USIMINAS -PREF.-	4,00
VALE, S.A.	BRVALEACNOR0	AC. VALE	11,56
VALE, S.A.	BRVALEACNPA3	AC. VALE. PREF. 6%	10,74
VERTICE TRESCIENTOS SESENTA GRADOS, S.A.	ES0183304312	VER/AC 0,07	0,10
VIDRALA, S.A.	ES0183746314	VID/AC 1,02	32,52
VINICOLA DEL NORTE DE ESPAÑA, S.A., CIA.	ES0184140210	CUN/AC 0,24	14,84
VISCOFAN, S.A.	ES0184262212	VIS/AC 0,70	40,40
VOCENTO, S.A.	ES0114820113	VOC/AC 0,20	1,46
VOLCAN COMPAÑIA MINERA, S.A.A.	PEP648014202	AC. VOLCAN. PREF. S/B	0,34
WORLD WIDE WEB IBERCOM, S.A.	ES0184696013	IBERCOM/AC 0,10	5,93
ZARDOYA OTIS, S.A.	ES0184933812	ZOT/AC 0,10	12,52
ZELTIA, S.A.	ES0184940817	ZEL/AC 0,05	2,52
ZINKIA ENTERTAINMENT, S.A.	ES0184849018	ZNK/AC 0,10	0,64

(*) ANCV: Agencia Nacional de Codificación de Valores
(**) V: Cupón Variable, C: Cupón Cero