

BASE DE DATOS NORMACEF FISCAL Y CONTABLE

Referencia: NFL017307

ORDEN HAP/303/2015, de 19 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 2014, a efectos de la declaración del Impuesto sobre el Patrimonio del año 2014 y de la declaración informativa anual acerca de valores, seguros y rentas.

(BOE de 26 de febrero de 2015)

La Ley 22/2013, de 23 de diciembre, de Presupuestos Generales del Estado para el año 2014, prorrogó durante dicho ejercicio la exigencia del gravamen del Impuesto sobre el Patrimonio a través de la modificación del Real Decreto-ley 13/2011, de 16 de septiembre, por el que restablece el Impuesto sobre el Patrimonio, con carácter temporal, que obliga a presentar declaración a los sujetos pasivos 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 millones 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 tanto los valores representativos de la cesión a terceros de capitales propios como los 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 2014; 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 2014, anexas a esta Orden, a efectos de la declaración del Impuesto sobre el Patrimonio del ejercicio 2014 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, 19 de febrero de 2015. 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 2014, a los efectos previstos en el artículo 39 del Real Decreto 1.065/2007, de 27 de julio, por el que se aprueba el Reglamento General de las actuaciones y los procedimientos de gestión e inspección tributaria y de desarrollo de las normas comunes de los procedimientos de aplicación de los tributos.

Criterio de ordenación:

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

RENTA FIJA

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

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
COMUNIDAD AUTONOMA DE CANARIAS	ES0000093361	CC.AA.CANA/4,929 OB 20200309	09/03/2020	4,929	116,110
COMUNIDAD DE MADRID	ES00000101263	CC.AA.MAD/4,30 OB 20260915	15/09/2026	4,300	115,375
COMUNIDAD DE MADRID	ES00000101388	CC.AA.MAD/4,622 BO 20150623	23/06/2015	4,622	102,445
COMUNIDAD DE MADRID	ES00000101396	CC.AA.MAD/4,688 OB 20200312	12/03/2020	4,688	117,267
COMUNIDAD DE MADRID	ES00000101446	CC.AA.MAD/6,213 BO 20160621	21/06/2016	6,213	108,752
COMUNIDAD DE MADRID	ES00000101495	CC.AA.MAD/5,50 BO 20170214	14/02/2017	5,500	110,350
COMUNIDAD DE MADRID	ES00000101503	CC.AA.MAD/4,75 BO 20150326	26/03/2015	4,750	101,503
COMUNIDAD DE MADRID	ES00000101545	CC.AA.MAD/5,75 BO 20180201	01/02/2018	5,750	114,966
COMUNIDAD DE MADRID	ES00000101586	CC.AA.MAD/2,875 OB 20190406	06/04/2019	2,875	107,172
COMUNIDAD DE MADRID	ES00000101602	CC.AA.MAD/4,125 OB 20240521	21/05/2024	4,125	116,263
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000011868	ESTADO/6,00 OBE SEGR 20290131	31/01/2029	6,000	140,182
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000011876	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20290131	31/01/2029	C	64,673
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000011892	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20150131	31/01/2015	C	99,962
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000011900	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20160131	31/01/2016	C	99,468
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000011918	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170131	31/01/2017	C	98,750
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000011926	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20180131	31/01/2018	C	97,489
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000011934	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20190131	31/01/2019	C	96,632
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000011942	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20200131	31/01/2020	C	93,884
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000011967	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20220131	31/01/2022	C	89,328
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000011983	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20240131	31/01/2024	C	82,727
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000012007	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20260131	31/01/2026	C	75,661
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000012023	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20270131	31/01/2027	C	73,629
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000012031	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20280131	31/01/2028	C	70,806
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000120C3	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20150131	31/01/2015	C	99,962
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000120D1	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20370131	31/01/2037	C	45,710
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000120G4	ESTADO/3,15 OBE SEGR 20160131	31/01/2016	3,150	103,083
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000120I0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20160131	31/01/2016	C	99,576
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000120J8	ESTADO/3,80 OBE SEGR 20170131	31/01/2017	3,800	107,293
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000120M2	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20170131	31/01/2017	C	98,856
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000120N0	ESTADO/4,90 OBE SEGR 20400730	30/07/2040	4,900	129,463
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000120P5	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20330730	30/07/2033	C	53,535
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000120R1	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20350730	30/07/2035	C	48,608
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000121A5	ESTADO/4,10 OBE SEGR 20180730	30/07/2018	4,100	111,891
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000121F4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20180730	30/07/2018	C	96,953
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000121G2	ESTADO/4,80 OBESEGR 20240131	31/01/2024	4,800	124,962
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000121K4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20240131	31/01/2024	C	82,697
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000121L2	ESTADO/4,60 OBESEGR 20190730	30/07/2019	4,600	117,190
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000121O6	ESTADO/4,30 OBESEGR 20191031	31/10/2019	4,300	116,078
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000121R9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20190730	30/07/2019	C	95,531
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000121S7	ESTADO/4,70 OBESEGR 20410730	30/07/2041	4,700	123,718
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000121V1	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20191031	31/10/2019	C	94,830
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000121Y5	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20151031	31/10/2015	C	99,681
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000122D7	ESTADO/4,00 OBESEGR 20200430	30/04/2020	4,000	115,093
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000122E5	ESTADO/4,65 OBESEGR 20250730	30/07/2025	4,650	123,017
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000122F2	ESTADO/3,00 BOEST SEGR 20150430	30/04/2015	3,000	101,340
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000122G0	ESTADO/VAR BOEST SEGR 20150317	17/03/2015	V	100,080
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000122I6	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20200430	30/04/2020	C	94,181
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000122M8	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20160430	30/04/2016	C	99,414
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000122N6	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170430	30/04/2017	C	98,349
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000122O4	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20180430	30/04/2018	C	97,480
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000122T3	ESTADO/4,85 OBESEGR 20201031	31/10/2020	4,850	121,261
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000122V9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20410730	30/07/2041	C	38,850
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000122W7	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20410730	30/07/2041	C	35,994
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000122X5	ESTADO/3,25 BOESTSEGR 20160430	30/04/2016	3,250	103,960
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000122Z0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20201031	31/10/2020	C	93,293
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000123B9	ESTADO/5,50 OBESEGR 20210430	30/04/2021	5,500	126,016
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000123C7	ESTADO/5,90 OBESEGR 20260730	30/07/2026	5,900	136,144
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000123E3	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20160430	30/04/2016	C	99,407
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000123F0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20210430	30/04/2021	C	92,647
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000123G8	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20210430	30/04/2021	C	90,408
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000123I4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20260730	30/07/2026	C	73,658
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000123J2	ESTADO/4,25 BOESTSEGR 20161031	31/10/2016	4,250	107,253
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000123K0	ESTADO/5,85 OBESEGR 20220131	31/01/2022	5,850	130,346
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000123L8	ESTADO/4,00 BOESTSEGR 20150730	30/07/2015	4,000	102,477
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000123N4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20220131	31/01/2022	C	89,908
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000123O2	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20150730	30/07/2015	C	99,824
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000000123P9	ESTADO/3,75 BOESTSEGR 20151031	31/10/2015	3,750	103,136

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123Q7	ESTADO/4,50 BOESTSEGR 20180131	31/01/2018	4,500	111,967
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123S3	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20151031	31/10/2015	C	99,670
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123T1	ESTADO/2,75 BOESTSEGR 20150331 CAC	31/03/2015	2,750	100,601
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123U9	ESTADO/5,40 OBESEGR 20230131 CAC	31/01/2023	5,400	128,402
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123V7	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20180131 CAC	31/01/2018	C	97,448
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123W5	ESTADO/3,30 BOESTSEGR 20160730 CAC	30/07/2016	3,300	104,801
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123X3	ESTADO/4,40 OBESEGR 20231031 CAC	31/10/2023	4,400	121,423
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012411	ESTADO/5,75 OBESEGR 20320730	30/07/2032	5,750	141,359
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124B7	ESTADO/3,75 BOESTSEGR 20181031 CAC	31/10/2018	3,750	111,594
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124C5	ESTADO/5,15 OBESEGR 20281031 CAC	31/10/2028	5,150	129,102
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124H4	ESTADO/5,15 OBESEGR 20441031 CAC	31/10/2044	5,150	134,097
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124I2	ESTADO/2,10 BOESTSEGR 20170430 CAC	30/04/2017	2,100	104,260
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124F7	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20231031 CAC	31/10/2023	C	84,112
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124V5	ESTADO/2,75 BOESTSEGR 20190430 CAC	30/04/2019	2,750	108,036
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124W3	ESTADO/3,80 OBESEGR 20240430 CAC	30/04/2024	3,800	117,234
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012593	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20320730	30/07/2032	C	96,568
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012601	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20150730	30/07/2015	C	99,795
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012619	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20160730	30/07/2016	C	99,077
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012635	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20180730	30/07/2018	C	96,812
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012643	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20190730	30/07/2019	C	95,220
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012650	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20200730	30/07/2020	C	94,048
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012668	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20210730	30/07/2021	C	90,427
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012684	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20230730	30/07/2023	C	84,601
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126A4	ESTADO/VAR OBESEGR 20241130 CAC	30/11/2024	V	108,994
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126B2	ESTADO/2,75 OBESEGR 20241031 CAC	31/10/2024	2,750	105,473
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126C0	ESTADO/1,40 BOESTSEGR 20200131 CAC	31/01/2020	1,400	101,728
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126D8	ESTADO/4,00 OBESEGR 20641031 CAC	31/10/2064	4,000	109,190
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126E6	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20441031 CAC	31/10/2044	C	35,324
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126U2	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20441031 CAC	31/10/2044	C	35,358
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126V0	ESTADO/0,50 BOESTSEGR 20171031 CAC	31/10/2017	0,500	99,220
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126W8	ESTADO/VAR BOESTSEGR 20191130 CAC	30/11/2019	V	101,385
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012700	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20250730	30/07/2025	C	77,499
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012759	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20300730	30/07/2030	C	60,637
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012775	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20320730	30/07/2032	C	57,580
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012783	ESTADO/5,50 OBE SEGR 20170730	30/07/2017	5,500	112,978
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012817	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20170730	30/07/2017	C	98,343
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012916	ESTADO/4,40 OBE SEGR 20150131	31/01/2015	4,400	100,764
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012932	ESTADO/4,20 OBE SEGR 20370131	31/01/2037	4,200	115,384
FONDO DE REESTRUCTURACION ORDENADA BANCARIA GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0302761020	FROB/5,50 BO 20160712 GTIA	12/07/2016	5,500	108,156
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950C3	GENCAT/VAR OB 20240908	08/09/2024	V	99,845
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950E9	GENCAT/4,95 OB 20200211	11/02/2020	4,950	99,535
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950F6	GENCAT/5,75 BO 20150625	25/06/2015	5,750	101,757
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095861	GENCAT/3,875 OB 20150915	15/09/2015	3,875	100,557
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095879	GENCAT/4,22 OB 20350426	26/04/2035	4,220	94,207
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095895	GENCAT/4,30 OB 20161115	15/11/2016	4,300	102,881
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095929	GENCAT/4,75 OB 20180604	04/06/2018	4,750	105,272
GOBIERNO VASCO	ES0000106437	GOB.VASCO/4,15 OB 20191028	28/10/2019	4,150	114,230
GOBIERNO VASCO	ES0000106445	GOB.VASCO/4,60 BO 20250107	07/01/2025	4,600	128,224
GOBIERNO VASCO	ES0000106486	GOB.VASCO/4,75 OB 20170705	05/07/2017	4,750	112,100
GOBIERNO VASCO	ES0000106494	GOB.VASCO/3,99 OB 20160128	28/01/2016	3,990	107,302
GOBIERNO VASCO	ES0000106510	GOB.VASCO/6,375 OB 20210420	20/04/2021	6,375	133,021
GOBIERNO VASCO	ES0000106528	GOB.VASCO/4,90 OB 20200326	26/03/2020	4,900	120,784
GOBIERNO VASCO	ES0000106536	GOB.VASCO/2,00 BO 20180723	23/07/2018	2,000	104,511
XUNTA DE GALICIA	ES0001352303	XUNTA/4,805 OB 20200326	26/03/2020	4,805	117,500
XUNTA DE GALICIA	ES0001352469	XUNTA/5,763 BO 20170403	03/04/2017	5,763	111,451
XUNTA DE GALICIA	ES0001352543	XUNTA/1,374 BO 20190510	10/05/2019	1,374	100,000

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

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950K6	GENCAT/VAR BO 20150330	30/03/2015	V	100,888
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0555281254	ICF/PAG 20150630	30/06/2015	C	99,281
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0555281270	ICF/PAG 20150731	31/07/2015	C	99,164

LETRAS DEL TESORO

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01501235	ESTADO/LT 20150123	23/01/2015	C	99,990
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01502209	ESTADO/LT 20150220	20/02/2015	C	99,976
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01503132	ESTADO/LT 20150313	13/03/2015	C	99,932
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01504106	ESTADO/LT 20150410	10/04/2015	C	99,908
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01505152	ESTADO/LT 20150515	15/05/2015	C	99,922
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01506192	ESTADO/LT 20150619	19/06/2015	C	99,887
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01507174	ESTADO/LT 20150717	17/07/2015	C	99,818
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01508214	ESTADO/LT 20150821	21/08/2015	C	99,753
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01509188	ESTADO/LT 20150918	18/09/2015	C	99,723
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01510160	ESTADO/LT 20151016	16/10/2015	C	99,731
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01511200	ESTADO/LT 20151120	20/11/2015	C	99,692
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01512117	ESTADO/LT 20151211	11/12/2015	C	99,752

OBLIGACIONES

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845203	ABE/4,375 OB 20200330	30/03/2020	4,375	117.073,89
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845211	ABE/5,125 OB 20170612	12/06/2017	5,125	55.938,14
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845237	ABE/4,625 OB 20161014	14/10/2016	4,625	54.046,05
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845252	ABE/4,75 OB 20191025	25/10/2019	4,750	118.350,81
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845260	ABE/3,75 OB 20230620	20/06/2023	3,750	116.504,49
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845294	ABE/2,50 OB 20250227	27/02/2025	2,500	103.798,09
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR LEONESA, S.A.	ES0211843091	AUCALSA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	511,31
AUTOPISTA VASCO-ARAGONESA, C.E.S.A.	ES0211837077	AVASA/3,55 OB 20150615	15/06/2015	3,550	1.007,11
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839149	AUDASA/3,32 OB 20151212	12/12/2015	3,320	505,43
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839156	AUDASA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	507,42
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839164	AUDASA/4,85 OB 20180327 GTIA	27/03/2018	4,850	522,55
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839172	AUDASA/6,00 OB 20210531 GTIA	31/05/2021	6,000	549,68
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839180	AUDASA/5,75 OB 20220516 GTIA	16/05/2022	5,750	651,32
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839198	AUDASA/5,20 OB 20230626 GTIA	26/06/2023	5,200	527,87
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839206	AUDASA/4,75 OB 20200401 GTIA	01/04/2020	4,750	523,12
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211107	BBVA/VAR OB SUBD 20220216	16/02/2022	V	60.688,85
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211156	BBVA/5,65 OB 20230616	16/06/2023	5,650	65.425,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214973051	CA.SABADELL/VAR OB SUBD 20200128	28/01/2020	V	97.741,90
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214973069	CA.SABADELL/VAR OB SUBD 20170215	15/02/2017	V	49.030,25
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214974042	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20190730	30/07/2019	V	855,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214974059	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20210809	09/08/2021	V	99.251,53
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214974067	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20210809	09/08/2021	V	94.800,76
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214974075	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD PERP	V	V	40.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214974117	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20190929	29/09/2019	V	1.035,51
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213051057	BCO.GALLEGO/2,00 OB 20191229	29/12/2019	2,000	35,74
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860036	SAB/VAR OB SUBD 20160525	25/05/2016	V	97.387,50
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860051	SAB/6,25 OB SUBD 20200426	26/04/2020	6,250	56.830,14
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0214400014	CAM/VAR OB SUBD PERP	24/02/2015	V	476,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0214400055	CAM/VAR OB 20150815	15/08/2015	V	948,91
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0215395015	CAM/VAR OB SUBD PERP	24/02/2015	V	486,22
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214959068	CA.SEGOVIA/2,00 OB 20160728	28/07/2016	2,000	17.279,74
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214983118	LA.CAJA/2,00 OB 20150412	12/04/2015	2,000	57.400,00
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0214845028	CAI/VAR OB SUBD 20160525	25/05/2016	V	18.500,00
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790001	POP/VAR OB SUBD 20191222	22/12/2019	V	49.985,73
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790019	POP/8,00 OB SUBD 20210729	29/07/2021	8,000	1.074,52
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790027	POP/8,25 OB SUBD 20211019	19/10/2021	8,250	1.086,80
BANKIA, S.A.	ES0213307004	BKIA/VAR OB SUBD 20240522	22/05/2024	V	97.989,61
BANKIA, S.A.	ES0214977094	BANCAJA/VAR OB 20160125	25/01/2016	V	99.213,87
BANKIA, S.A.	ES0214977144	BANCAJA/4,375 OB 20170214	14/02/2017	4,375	107.170,21
BANKINTER, S.A.	ES0213679088	BKT/VAR OBESTR 20190218 19	18/02/2019	V	49.261,56
BANKINTER, S.A.	ES0213679097	BKT/VAR OBESTR 20190304 25	04/03/2019	V	49.688,83
BANKINTER, S.A.	ES0213679001	BKT/VAR OBESTR 20190327 36	27/03/2019	V	24.371,63
BANKINTER, S.A.	ES0213679196	BKT/6,375 OB SUBD 20190911	11/09/2019	6,375	58.270,96
BANKINTER, S.A.	ES02136791E0	BKT/VAR OBESTR 20190423 57	23/04/2019	V	49.555,95
BANKINTER, S.A.	ES02136791Y8	BKT/VAR OBESTR 20190624 89	24/06/2019	V	50.097,26
BANKINTER, S.A.	ES0213679258	BKT/VAR OBESTR 20190729 114	29/07/2019	V	48.689,74
BANKINTER, S.A.	ES0213679223	BKT/VAR OBESTR 20190805 123	05/08/2019	V	24.025,73
BANKINTER, S.A.	ES02136793P2	BKT/VAR OBESTR 20190904 148	04/09/2019	V	25.146,95
BANKINTER, S.A.	ES02136794F1	BKT/VAR OBESTR 20191015 168	15/10/2019	V	24.507,36
BANKINTER, S.A.	ES02136794H7	BKT/VAR OBESTR 20191009 169	09/10/2019	V	49.031,02
BANKINTER, S.A.	ES02136795P7	BKT/VAR OBESTR 20191212 218	12/12/2019	V	50.000,00
BANKINTER, S.A.	ES02136795R3	BKT/VAR OBESTR 20191218 221	18/12/2019	V	25.000,00
BANKINTER, S.A.	ES0213679972	BKT/VAR OBESTR 20190220 10	20/02/2019	V	24.563,21
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0257080012	BPEF/VAR OB SUBD 20151223	23/12/2015	V	98.500,00
CAIXABANK, S.A.	ES0213249008	CA.GIRONA/VAR OB SUBD 20160921	21/09/2016	V	98.197,17
CAIXABANK, S.A.	ES0214965008	CAN/VAR OB SUBD 20160616	16/06/2016	V	99.285,27
CAIXABANK, S.A.	ES0214979157	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20151128	28/11/2015	V	983,87
CAIXABANK, S.A.	ES0214979181	CA.GUADALAJ/VAR OBSUBD 20191230	30/12/2019	V	1.019,09
CAIXABANK, S.A.	ES0214981070	CA.JACANARIAS/VAR OB SUBD 20151104	04/11/2015	V	99.600,32
CAIXABANK, S.A.	ES0240609000	CABK/4,00 OB SUBD 20220209 I	09/02/2022	4,000	105,09
CAIXABANK, S.A.	ES0240609018	CABK/5,00 OB SUBD 20220209 II	09/02/2022	5,000	107,88
CAJAS RURALES UNIDAS, SOCIEDAD COOP. DE CREDITO	ES0214601017	CAJAMAR/VAR OBSUBD 20150316	16/03/2015	V	97.699,82
CAJAS RURALES UNIDAS, SOCIEDAD COOP. DE CREDITO	ES0215316029	RURALCAJA/VAR OBSUBD 20151122	22/11/2015	V	96.262,87
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICAS DE PRODUCTOS PETROLIFEROS	ES0224261018	CORES/4,50 OB 20180423	23/04/2018	4,500	111.834,45
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICAS DE PRODUCTOS PETROLIFEROS	ES0224261026	CORES/3,25 OB 20160419	19/04/2016	3,250	103.739,01
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICAS DE PRODUCTOS PETROLIFEROS	ES0224261034	CORES/2,50 OB 20241016	16/10/2024	2,500	100.399,83
CRITERIA CAIXAHOLDING, S.A.U.	ES0214970073	LACAIXA/VAR OBSUBD 20200330	30/03/2020	V	1.006,56
CRITERIA CAIXAHOLDING, S.A.U.	ES0214970081	LACAIXA/7,50 OB SUBD 20170131	31/01/2017	7,500	1.119,23
ENAGAS TRANSPORTE, S.A.U.	ES0230960009	ENG/4,375 OB 20150706	06/07/2015	4,375	51.119,29
EROSKI, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429004	EROSKI/VAR OB SUBD PERP	V	V	11,38
EROSKI, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429038	EROSKI/VAR OB SUBD PERP	V	V	11,06
FERROVIAL EMISIONES, S.A.	ES0205032008	FER EMI/2,50 OB 20240715	15/07/2024	2,500	104.168,34
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0214954135	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20180420	20/04/2018	V	463,99
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0214954150	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20190425	25/04/2019	V	454,69
LIBERBANK, S.A.	ES0268675008	LIBERBK/5,00 OB SUBD CONV 20180717 A	17/07/2018	5,000	3,34
LIBERBANK, S.A.	ES0268675016	LIBERBK/5,00 OB SUBD CONV 20180717 B	17/07/2018	5,000	3,89
LIBERBANK, S.A.	ES0268675024	LIBERBK/7,00 OB SUBD CONV 20180717 C	17/07/2018	7,000	10,30
MAPFRE, S.A.	ES0224244063	MAP/VAR OB SUBD 20370724	24/07/2037	V	53.706,14
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0213495007	SAN.CONS.FIN/VAR OB SUBD 20160928	28/09/2016	V	49.869,94
UNIVERSIDAD POLITECNICA DE VALENCIA	ES0282103003	UPV/6,60 OB 20221215	15/12/2022	6,600	6.847,73
UNIVERSITAT JAUME I DE CASTELLON	ES0282104001	UNIV.JA.I.CAST/VAR OB 20171215	15/12/2017	V	6.469,29

BONOS

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.	ES0314958069	CAIXANOVA/3,125 BO 20150415 GTIA	15/04/2015	3,125	50.511,85
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR LEONESA, S.A.	ES0311843009	AUCALSA/4,35 BO 20190609	09/06/2019	4,350	520,41
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298013	AYT.CCG/3,50 BTA 20160314 II GTIA	14/03/2016	3,500	103.735,17
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298021	AYT.CCG/3,75 BTA 20221214 III GTIA	14/12/2022	3,750	116.348,12
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298039	AYT.CCG/VAR BTA 20180222 IV GTIA	22/02/2018	V	98.259,60
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298054	AYT.CCG/4,00 BTA 20210324 VI GTIA	24/03/2021	4,000	117.113,09
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298070	AYT.CCG/4,25 BTA 20180614 VIII GTIA	14/06/2018	4,250	112.151,18
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298096	AYT.CCG/4,25 BTA 20231025 X GTIA	25/10/2023	4,250	121.104,97
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298104	AYT.CCG/4,00 BTA 20161220 XI GTIA	20/12/2016	4,000	107.056,39
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298112	AYT.CCG/4,00 BTA 20170321 XII GTIA	21/03/2017	4,000	107.894,82
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298120	AYT.CCG/4,75 BTA 20270525 XIII GTIA	25/05/2027	4,750	125.994,82
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298195	AYT.CCG/VAR BTA 20151124 XX GTIA	24/11/2015	V	100.730,58
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298229	AYT.CCG/4,75 BTA 20160615 XXIII	15/06/2016	4,750	106.420,16
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298245	AYT.CCG/4,50 BTA 20191202 XXV GTIA	02/12/2019	4,500	117.266,50
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298252	AYT.CCG/3,75 BTA 20150525 XXVI GTIA	25/05/2015	3,750	101.795,00
AYT CEDULAS CAJAS IX, F.T.A.	ES0312358007	AYT.CED.CA.IX/3,75 BTA 20150331 A	31/03/2015	3,750	101.165,47
AYT CEDULAS CAJAS IX, F.T.A.	ES0312358015	AYT.CED.CA.IX/4,00 BTA 20200331 B	31/03/2020	4,000	115.531,61
AYT CEDULAS CAJAS V, F.T.A.	ES03070148019	AYT.CED.CA.V/4,75 BTA 20181204 B	04/12/2018	4,750	115.985,43
AYT CEDULAS CAJAS VIII, F.T.A.	ES0312362017	AYT.CED.CA.VIII/4,25 BTA 20191118 B	18/11/2019	4,250	116.797,51
AYT CEDULAS CAJAS X, F.T.A.	ES0312342001	AYT.CED.CA.X/VAR BTA 20150630 A	30/06/2015	V	99.791,00
AYT CEDULAS CAJAS X, F.T.A.	ES0312342019	AYT.CED.CA.X/3,75 BTA 20250630 B	30/06/2025	3,750	116.053,82
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A.	ES0312273214	COLAT.GLB.HIP./VAR BTA 20470524 B	24/05/2047	V	99.524,47
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A.	ES0312273222	COLAT.GLB.HIP./VAR BTA 20470524 C	24/05/2047	V	99.099,47
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A.	ES0312273230	COLAT.GLB.HIP./VAR BTA 20470524 D	24/05/2047	V	98.627,25
AYT DEUDA SUBORDINADA I, F.T.A.	ES0312284005	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 A	17/11/2016	V	61.675,70
AYT DEUDA SUBORDINADA I, F.T.A.	ES0312284013	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 B	17/11/2016	V	72.129,36
AYT FTPYME II, F.T.A.	ES0312363023	AYT.FTPYME.II/VAR BTA 20321020 T2	20/10/2032	V	12.228,36
AYT FTPYME II, F.T.A.	ES0312363031	AYT.FTPYME.II/VAR BTA 20321020 F3	20/10/2032	V	73.124,83
AYT GENOVA HIPOTECARIO II, F.T.H.	ES03070139000	AYT.GEN.H.II/VAR BTH 20341215 A	15/12/2034	V	21.484,11
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, F.T.H.	ES0312300017	AYT.GEN.H.IX/VAR BTH 20390715 A2	15/07/2039	V	30.413,40
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, F.T.H.	ES0312343017	AYT.GEN.H.VII/VAR BTH 20380915 A2	15/09/2038	V	24.831,84
AYT HIPOTECARIO III, F.T.H.	ES0312369004	AYT.HIP.III/VAR BTH 20330318 A GTIA	18/03/2033	V	14.281,98
AYT HIPOTECARIO IV, F.T.H.	ES0312370002	AYT.HIP.IV/VAR BTH 20330613 A GTIA	13/06/2033	V	10.480,07
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, F.T.A.	ES0312378005	AYT.HIP.MIX.III/VAR BTA 20380321 A	21/03/2038	V	16.252,15
AYT HIPOTECARIO MIXTO, F.T.A.	ES0312371000	AYT.HIP.MIX/VAR BTA 20330915 A GTIA	15/09/2033	V	10.904,06
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, F.T.A.	ES03070153001	KUTXA.HIP./VAR BTA 20410422 A GTIA	22/04/2041	V	44.271,08
BANCAJA 11, F.T.A.	ES0312867015	BANCAJA.11/VAR BTA 20500427 A2 GTIA	27/04/2050	V	49.372,75
BANCAJA 6, FONDO DE TITULACION DE ACTIVOS	ES0312885017	BANCAJA.6/VAR BTA 20360220 A2 GTIA	20/02/2036	V	16.734,12
BANCAJA 8, F.T.A.	ES0312887013	BANCAJA.8/VAR BTA 20371025 B GTIA	25/10/2037	V	53.057,15
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211445	BBVA/VAR BOESTR 20151029 20	29/10/2015	V	39.091,10
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211882	BBVA/0,96 BO 20150116	16/01/2015	0,960	100.124,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211916	BBVA/2,35 BO 20180316	16/03/2018	2,350	104.822,22
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0313377030	BCO.COOP.ESP/3,125 BO 20150122 GTIA	22/01/2015	3,125	50.249,84
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA, S.A.	ES0314854136	CAJADUERO/3,782 BO 20150623 GTIA	23/06/2015	3,782	50.925,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313212021	BCO.CAMI/4,50 BO 20170309 GTIA	09/03/2017	4,500	50.113,88
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860005	SAB/1,095 BO 20160504	04/05/2016	1,095	1.000,58
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860024	SAB/VAR BOESTR 20161110 9	10/11/2016	V	100.000,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860449	SAB/VAR BOSUBDCONV 20150721 I	21/07/2015	V	563,63
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860456	SAB/10,20 BOSUBDCONV 20151111 II	11/11/2015	10,200	2,98
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	0,77
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860613	SAB/2,50 BO 20161205	05/12/2016	2,500	102.960,69
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0314950678	CA.MADRID/4,375 BO 20151130 GTIA	30/11/2015	4,375	52.200,50
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0314950694	CA.MADRID/5,25 BO 20160407 GTIA	07/04/2016	5,250	53.128,95
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0314977366	BANCAJA/3,125 BO 20150121 GTIA	21/01/2015	3,125	50.212,00
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0335701019	CAJATRES/CUPCER BO 20160525 B	25/05/2016	C	18.328,38
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0314966187	CA.PENEDES/VAR BO 20150506 GTIA	06/05/2015	V	49.709,65
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0313790059	POP/7,00 BOSUBDCONV 20151125	25/11/2015	7,000	307,64
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0313440143	BTO/4,08 BO 20160323	23/03/2016	4,080	104.791,87
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0313440150	BTO/3,00 BO 20150417	17/04/2015	3,000	1.012,58
BANKIA, S.A.	ES0313307003	BKIA/3,50 BO 20190117	17/01/2019	3,500	107.639,25
BANKINTER 10, F.T.A.	ES0313529010	BKT.10/VAR BTA 20430621 A2 GTIA	21/06/2043	V	35.858,73
BANKINTER 11, F.T.H.	ES0313714018	BKT.11/VAR BTH 20480821 A2 GTIA	21/08/2048	V	40.125,89
BANKINTER 13, F.T.A.	ES0313270011	BKT.13/VAR BTA 20490717 A2 GTIA	17/07/2049	V	50.520,15
BANKINTER 2 PYME, F.T.A.	ES0313716013	BKT.2.PYME/VAR BTA 20430516 A2 GTIA	16/05/2043	V	10.812,28
BANKINTER 2, F.T.H.	ES0313800031	BKT.2/VAR BTH 20340722 A4 GTIA	22/01/2015	V	9.752,42
BANKINTER 3, F.T.H.	ES0314019003	BKT.3/VAR BTH 20381016 A GTIA	16/10/2038	V	11.616,17
BANKINTER 4, F.T.H.	ES0313919005	BKT.4/VAR BTH 20381112 A GTIA	12/11/2038	V	16.772,11
BANKINTER 6, F.T.A.	ES0313546006	BKT.6/VAR BTA 20380826 A GTIA	26/08/2038	V	23.584,22
BANKINTER 7, F.T.H.	ES0313547004	BKT.7/VAR BTH 20400926 A GTIA	26/09/2040	V	23.878,22
BANKINTER 8, F.T.A.	ES0313548002	BKT.8/VAR BTA 20401215 A GTIA	15/12/2040	V	24.253,32
BANKINTER 9, F.T.A.	ES0313814016	BKT.9/VAR BTA 20420716 A2P GTIA	16/07/2042	V	33.339,46
BANKINTER 9, F.T.A.	ES0313814057	BKT.9/VAR BTA 20420716 A2T GTIA	16/07/2042	V	39.431,06
BANKINTER, S.A.	ES03136793B0	BKT/1,75 BO 20190610	10/06/2019	1,750	102.427,89
BANKINTER, S.A.	ES03136793X4	BKT/VAR BOESTR 20171009 178	09/10/2017	V	99.998,34
BANKINTER, S.A.	ES03136794L7	BKT/VAR BOESTR 20161227 234	27/12/2016	V	49.998,09
BANKINTER, S.A.	ES03136794M5	BKT/VAR BOESTR 20161227 237	27/12/2016	V	99.996,18
BBVA CONSUMO 2, F.T.A.	ES0313956015	BBVA.CONSUMO.2/VAR BTA 20201220 B	20/12/2020	V	8.971,99

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
BBVA HIPOTECARIO 3, F.T.A.	ES0314227010	BBVA.HIP.3/VAR BTA 20381121 A2 GTIA	21/11/2038	V	1.689,20
BBVA LEASING 1, F.T.A.	ES0314209034	BBVA.LEASING.1/VAR BTA 20310526 C	26/05/2031	V	15.029,75
BBVA RMBS 1, F.T.A.	ES0314147010	BBVA.RMBS1/VAR BTA 20500619 A2 GTIA	19/06/2050	V	49.385,60
BBVA RMBS 2, F.T.A.	ES0314148018	BBVA.RMBS2/VAR BTA 20500917 A2 GTIA	17/09/2050	V	42.874,63
BBVA RMBS 2, F.T.A.	ES0314148034	BBVA.RMBS2/VAR BTA 20500917 A4 GTIA	17/09/2050	V	99.993,65
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467613	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20150414 65	14/04/2015	V	49.950,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467829	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20161212	12/12/2016	C	25.325,57
BBVA-8 FTPYME, F.T.A.	ES0370462014	BBVA8.PYME/VAR BTA 20411216 A2G	16/12/2041	V	3.507,24
CAIXA PENEDES 1 TDA, F.T.A.	ES0313252001	CA.PENEDES1.TDA/VAR BTA 20430128 A	28/01/2043	V	36.769,29
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, F.T.A.	ES0318559012	PENEDES.GENCAT1/VAR BTA 20491125 A2	25/11/2049	V	4.595,29
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, F.T.A.	ES0357326000	PENEDES.PYMES.1/VAR BTA 20450928 A	28/09/2045	V	9.257,23
CAIXABANK, S.A.	ES0340609058	CABK/4,91 BO 20150120	20/01/2015	4,910	1.009,13
CAIXABANK, S.A.	ES0340609090	CABK/VAR BOESTR 20150420	20/04/2015	V	74.933,91
CAIXABANK, S.A.	ES0340609140	CABK/3,25 BO 20160122	22/01/2016	3,250	103.235,42
CAIXABANK, S.A.	ES0340609199	CABK/3,125 BO 20180514	14/05/2018	3,125	108.253,39
CAIXABANK, S.A.	ES0340609207	CABK/VAR BOESTR 20161024	24/10/2016	V	99.463,42
CAIXABANK, S.A.	ES0340609215	CABK/2,50 BO 20170418	18/04/2017	2,500	104.586,84
CAIXABANK, S.A.	ES0340609231	CABK/VAR BOESTR 20180813	13/08/2018	V	100.542,05
CAIXABANK, S.A.	ES0358197038	CAJASOL/3,25 BO 20150225 GTIA	25/02/2015	3,250	50.267,21
CAIXABANK, S.A.	ES0358197046	CAJASOL/3,624 BO 20150430 GTIA	30/04/2015	3,624	50.782,50
CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, F.T.A.	ES0318822006	CED.POP.3/4,25 BTA 20170426 GTIA	26/04/2017	4,250	109.152,70
CEDULAS TDA 3, F.T.A.	ES0317043000	CED.TDA.3/4,38 BTA 20160303 1 GTIA	03/03/2016	4,375	104.933,08
CEDULAS TDA 5, F.T.A.	ES0317045005	CED.TDA.5/4,13 BTA 20191129 A GTIA	29/11/2019	4,125	115.443,43
CEDULAS TDA 6, F.T.A.	ES0317046003	CED.TDA.6/3,88 BTA 20250523 GTIA	23/05/2025	3,875	118.771,99
CEDULAS TDA 7, F.T.A.	ES0317047001	CED.TDA.7/3,50 BTA 20170620 GTIA	20/06/2017	3,500	107.040,45
CRITERIA CAIXAHOLDING, S.A.U.	ES0314970239	LACAIXA/2,375 BO 20190509	09/05/2019	2,375	103.710,12
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014047	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20160509 8	09/05/2016	V	1.022,65
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014054	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20160615 10	15/06/2016	V	999,27
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014104	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20190710 14	10/07/2019	V	1.005,07
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014179	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20171030 25	30/10/2017	V	990,13
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014237	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20171124 33	24/11/2017	V	994,64
F.T.A. PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZACION DE CEDULAS HIPOTECARIAS	ES0334699008	PRG.IND.CED.HIP/5,125 BTA 20220720	20/07/2022	5,125	127.669,16
FONCAIXA FTGENCAT 3, F.T.A.	ES0337937017	FONCAIXA.GCAT.3/VAR BTA 20380901 AG	01/09/2038	V	20.111,71
FONCAIXA FTGENCAT 4, F.T.A.	ES0338013016	FONCAIXA.GCAT.4/VAR BTA 20490310 AG	10/03/2049	V	40.517,41
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS PYMES SANTANDER 10	ES0305054001	PYMES SAN 10/VAR BTA 20570820 A	20/08/2057	V	99.996,83
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER FINANCIACION 1	ES0382043042	SAN.FINAN.1/VAR BTA 20350720 E GTIA	20/07/2035	V	99.993,36
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPOTECARIO 2	ES0382042002	SAN.HIP.2/VAR BTA 20490118 A GTIA	18/01/2049	V	34.510,58
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPOTECARIO 3	ES0338093067	SAN.HIP.3/VAR BTA 20500118 E GTIA	18/01/2050	V	99.993,36
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER PUBLICO 1	ES0338185004	SAN.PUBLICO.1/VAR BTA 20370115 A	15/01/2037	V	7.771,05
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 11	ES0338340005	UCI.11/VAR BTA 20410915 A GTIA	15/09/2041	V	21.724,62
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 6	ES0338558002	UCI.6/VAR BTA 20301116 A GTIA	16/11/2030	V	7.969,51
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 7	ES0338355003	UCI.7/VAR BTA 20330317 A GTIA	17/03/2033	V	10.229,63
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 8	ES0338446000	UCI.8/VAR BTA 20331218 A GTIA	18/12/2033	V	11.136,70
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 9	ES0338222005	UCI.9/VAR BTA 20350619 A GTIA	19/06/2035	V	14.483,25
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, FTPYME SANTANDER 1	ES0339773014	PYME.SAN.1/VAR BTA 20341115 B1G	15/11/2034	V	5.465,21
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641015	FADE/5,00 BTA 20150617 2 GTIA	17/06/2015	5,000	102.768,57
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641023	FADE/5,90 BTA 20210317 3 GTIA	17/03/2021	5,900	127.291,84
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641031	FADE/5,60 BTA 20180917 4 GTIA	17/09/2018	5,600	117.297,52
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641080	FADE/6,25 BTA 20250317 9 GTIA	17/03/2025	6,250	137.214,29
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641114	FADE/4,875 BTA 20171217 12 GTIA	17/12/2017	4,875	112.010,86
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641122	FADE/4,00 BTA 20151217 13 GTIA	17/12/2015	4,000	103.821,27
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641130	FADE/4,125 BTA 20170317 14 GTIA	17/03/2017	4,125	107.804,06
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641155	FADE/3,875 BTA 20180317 16 GTIA	17/03/2018	3,875	109.889,24
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641163	FADE/2,875 BTA 20160917 17 GTIA	17/09/2016	2,875	103.921,23
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641171	FADE/3,375 BTA 20190317 18 GTIA	17/03/2019	3,375	110.314,33
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641189	FADE/2,25 BTA 20161217 19 GTIA	17/12/2016	2,250	103.235,35
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641197	FADE/1,875 BTA 20170917 20 GTIA	17/09/2017	1,875	103.056,53
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 10	ES0338146006	UCI.10/VAR BTH 20360622 A GTIA	22/06/2036	V	19.485,47
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 12	ES0338147004	UCI.12/VAR BTH 20391215 A GTIA	15/12/2039	V	29.563,98
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 5	ES0338557004	UCI.5/VAR BTH 20290215 A GTIA	15/02/2029	V	5.625,32
FTPYME BANCAJA 2, F.T.A.	ES0339751028	PYME.BANCAJA.2/VAR BTA 20300115 A3G	15/01/2015	V	478,55
FTPYME BANCAJA 6, F.T.A.	ES0339755021	PYME.BANCAJA.6/VAR BTA 20450927 A3G	27/09/2045	V	26.123,77
FTPYME TDA CAM 4, F.T.A.	ES0339759013	PYME.TDA.CAM.4/VAR BTA 20450928 A2	28/09/2045	V	7.740,72
GAT FTGENCAT 2007, F.T.A.	ES0341081018	GAT.GENCAT.07/VAR BTA 20491215 A2G	15/12/2049	V	13.317,78
GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 1, F.T.A.	ES0341098012	GC.CAIXA.SAB.1/VAR BTA 20401031 AG	26/01/2015	V	2.249,14
GC FTGENCAT CAIXA TARRAGONA 1, F.T.A.	ES0341082016	GC.CAIXA.TAR.1/VAR BTA 20630630 AG	30/06/2063	V	18.299,69
GC SABADELL 1, F.T.H.	ES0316874017	GC.SAB.1/VAR BTH 20380620 A2 GTIA	20/06/2038	V	24.053,27
HIPOCAT 11, F.T.A.	ES0345672010	HIPOCAT.11/VAR BTA 20500115 A2 GTIA	15/01/2050	V	22.424,78
HIPOCAT 4, F.T.A.	ES0372269003	HIPOCAT.4/VAR BTA 20331215 A GTIA	15/12/2033	V	12.703,22
HIPOCAT 5, F.T.A.	ES0344264009	HIPOCAT.5/VAR BTA 20331130 A GTIA	30/11/2033	V	15.387,82
HIPOCAT 7, F.T.A.	ES0345783015	HIPOCAT.7/VAR BTA 20360715 A2 GTIA	15/07/2036	V	24.941,39
HIPOCAT 8, F.T.A.	ES0345784013	HIPOCAT.8/VAR BTA 20380315 A2 GTIA	15/03/2038	V	23.533,95
HIPOCAT 9, F.T.A.	ES0345721015	HIPOCAT.9/VAR BTA 20380715 A2A GTIA	15/07/2038	V	38.374,05
IM BANCO POPULAR FTPYME 1, F.T.A.	ES0347847016	IM.POP.PYME/VAR BTA 20430424 AG	24/04/2043	V	5.630,16
IM CAJA LABORAL 1, F.T.A.	ES0347565006	IM.CA.LABORAL.1/VAR BTA 20491024 A	24/10/2049	V	38.620,49
IM CAJAMAR EMPRESAS 2 FTPYME, F.T.A.	ES0347553010	CAJAMAR.EMP.2/VAR BTA 20511024 A2G	24/10/2051	V	9.381,88
IM CAJAMAR EMPRESAS 5, F.T.A.	ES0347431001	CAJAMAR.EMP.5/3,178 BTA 22551120 A1	22/11/2055	3,178	27.585,08
IM CEDULAS 10, F.T.A.	ES0349045007	IM.CED.10/4,50 BTA 20220221 GTIA	21/02/2022	4,500	121.403,67

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
IM CEDULAS 4, F.T.A.	ES0347848006	IM.CED.4/3,75 BTA 20150311 A GTIA	11/03/2015	3,750	101.062,49
IM CEDULAS 5, F.T.A.	ES0347849004	IM.CEDULAS 5/3,50 BTA 20200615 GTIA	15/06/2020	3,500	111.986,57
IM CEDULAS 7, F.T.A.	ES0347784003	IM.CED.7/4,00 BTA 20210331 GTIA	31/03/2021	4,000	116.756,93
IM CEDULAS 9, F.T.A.	ES0347785000	IM.CED.9/4,25 BTA 20160609 GTIA	09/06/2016	4,250	105.548,87
IM FTGENCAT SABADELL 2, F.T.A.	ES0347842017	IM.GENCAT.SAB.2/VAR BTA 20281116 AG	16/11/2028	V	26.046,87
IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, F.T.A.	ES0347843015	IM.POP.EMP.1/VAR BTA 20330321 A2	21/03/2033	V	5.093,12
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I, F.T.A.	ES0347844047	IM.POP.PYME.I/VAR BTA 20390921 A5G	21/09/2039	V	82.527,44
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME II, F.T.A.	ES0347786024	IM.POP.PYME.II/VAR BTA 20410124 A3G	24/01/2041	V	11.498,31
IM PASTOR 2, F.T.H.	ES0347861009	IM.PASTOR 2/VAR BTH 20410922 A GTIA	22/09/2041	V	16.699,26
IM TERRASSA MBS 1, F.T.A.	ES0347855001	IM.TERR.MBS.1/VAR BTA 20490724 A	24/07/2049	V	28.270,67
INTERMONEY MASTER CEDULAS, F.T.A.	ES0362859003	INTER.MAST.CED/3,50 BTA 20151202 M1	02/12/2015	3,500	103.043,48
KUTXABANK, S.A.	ES0314100068	BBK/4,38 BO 20150928	28/09/2015	4,380	103.493,10
KUTXABANK, S.A.	ES0314100076	BBK/4,40 BO 20160301	01/03/2016	4,400	104.804,59
MADRID RMBS I, F.T.A.	ES0359091016	MADRID.RMBS.I/VAR BTA 20490622 A2	22/06/2049	V	47.958,26
MAPFRE, S.A.	ES0324244005	MAP/5,125 BO 20151116	16/11/2015	5,125	104.701,82
MBS BANCAJA 1, F.T.A.	ES0361794003	MBS.BANCAJA.1/VAR BTA 20351117 A	17/11/2035	V	7.740,52
MBS BANCAJA 2, F.T.A.	ES0361795000	MBS.BANCAJA.2/VAR BTA 20380225 A	25/02/2038	V	18.618,89
MELIA HOTELS INTERNATIONAL, S.A.	ES0376252005	MEL/7,80 BO 20160731	31/07/2016	7,800	100,05
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622004	PROG.CED.TDA/VAR BTA 20160408 A1	08/04/2016	V	99.633,71
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622012	PROG.CED.TDA/4,13 BTA 20210410 A4	10/04/2021	4,125	118.394,82
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622020	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20310410 A6	10/04/2031	4,250	121.331,69
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622038	PROG.CED.TDA/4,00 BTA 20181023 A3	23/10/2018	4,000	112.685,00
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622046	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20270328 A5	28/03/2027	4,250	121.283,50
PYMES BANESTO 2, F.T.A.	ES0372260010	PYMES.BTO.2/VAR BTA 20311231 A2	31/12/2031	V	14.315,79
PYMES BANESTO 2, F.T.A.	ES0372260036	PYMES.BTO.2/VAR BTA 20311231 C	31/12/2031	V	39.296,66
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, F.T.A.	ES0374273003	RURAL.HIP.GBL.I/VAR BTA 20390118 A	18/01/2039	V	27.615,71
RURAL HIPOTECARIO IV, F.T.H.	ES0358283002	RURAL.HIP.IV/VAR BTH 20330213 A	13/02/2033	V	10.755,32
RURAL HIPOTECARIO IX, F.T.A.	ES0374274019	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 A2	17/02/2050	V	40.285,60
RURAL HIPOTECARIO IX, F.T.A.	ES0374274027	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 A3	17/02/2050	V	65.064,11
RURAL HIPOTECARIO V, F.T.H.	ES0358284000	RURAL.HIP.V/VAR BTH 20350315 A1	15/03/2035	V	22.319,38
RURAL HIPOTECARIO VII, F.T.A.	ES0366366005	RURAL.HIP.VII/VAR BTA 20380315 A1	15/03/2038	V	28.324,50
RURALPYME 2 FTPYME, F.T.A.	ES0374352013	RURALPYME.2/VAR BTA 20300425 A2G	25/04/2030	V	27.490,79
SOCIEDAD DE GESTION DE ACTIVOS PROC. DE LA REESTR. BANCARIA, S.A.	ES0352506028	SAREB/VAR BO 20151231 2012-3	31/12/2015	V	99.923,85
SOCIEDAD DE GESTION DE ACTIVOS PROC. DE LA REESTR. BANCARIA, S.A.	ES0352506044	SAREB/VAR BO 20150228 2013-2	28/02/2015	V	99.822,37
SOCIEDAD DE GESTION DE ACTIVOS PROC. DE LA REESTR. BANCARIA, S.A.	ES0352506051	SAREB/VAR BO 20160228 2013-3	28/02/2016	V	99.908,06
SOCIEDAD DE GESTION DE ACTIVOS PROC. DE LA REESTR. BANCARIA, S.A.	ES0352506077	SAREB/VAR BO 20150228 2014-1	28/02/2015	V	99.986,94
TDA 13-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377977006	TDA 13-MIXTO/VAR BTH 20151026 A1	26/10/2015	V	5.436,92
TDA 13-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377977022	TDA 13-MIXTO/VAR BTH 20151026 A2	26/10/2015	V	4.633,44
TDA 15-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377979028	TDA.15-MIX/VAR BTA 20420627 A2 GTIA	27/06/2042	V	14.671,06
TDA 18-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377989001	TDA 18-MIXTO/VAR BTA 20450622 A1	22/06/2045	V	17.680,25
TDA 18-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377989019	TDA 18-MIXTO/VAR BTA 20450622 A2	22/06/2045	V	10.907,28
TDA 19-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377964004	TDA 19-MIXTO/VAR BTA 20360322 A	22/03/2036	V	20.376,83
TDA 20-MIXTO, F.T.A.	ES0377981008	TDA.20-MIX/VAR BTA 20360426 A1 GTIA	26/04/2036	V	21.994,07
TDA 20-MIXTO, F.T.A.	ES0377981024	TDA.20-MIX/VAR BTA 20360426 A2 GTIA	26/04/2036	V	18.194,17
TDA 22-MIXTO, F.T.A.	ES0377983012	TDA 22-MIXTO/VAR BTA 20460628 A1B	28/06/2046	V	85.153,98
TDA 27, F.T.A.	ES0377954013	TDA.27/VAR BTA 20501228 A2 GTIA	28/12/2050	V	35.592,93
TDA CAJAMAR 2, F.T.A.	ES0377965019	TDA.CAJAMAR.2/VAR BTA 20410626 A2	26/06/2041	V	12.322,11
TDA CAM 1, F.T.A.	ES0338448006	TDA CAM 1/VAR BTA 20320922 A GTIA	22/09/2032	V	13.292,18
TDA CAM 4, F.T.A.	ES0377991007	TDA.CAM.4/VAR BTA 20390626 A GTIA	26/06/2039	V	23.364,60
TDA CAM 5, F.T.A.	ES0377992005	TDA.CAM.5/VAR BTA 20431026 A GTIA	26/10/2043	V	33.558,55
TDA CAM 6, F.T.A.	ES0377993029	TDA.CAM.6/VAR BTA 20440428 A3 GTIA	28/04/2044	V	37.650,33
TDA CAM 7, F.T.A.	ES0377994019	TDA.CAM.7/VAR BTA 20490226 A2 GTIA	26/02/2049	V	35.160,40
TDA CAM 8, F.T.A.	ES0377966009	TDA.CAM.8/VAR BTA 20490226 A GTIA	26/02/2049	V	38.032,45
TDA IBERCAJA 1, F.T.A.	ES0338450002	TDA IBERCAJA 1/VAR BTA 20350726 A	26/07/2035	V	20.212,51
TDA IBERCAJA 2, F.T.A.	ES0338451000	TDA IBERCAJA 2/VAR BTA 20421026 A	26/10/2042	V	35.167,53
TDA IBERCAJA 3, F.T.A.	ES0338452008	TDA.IBERCAJA.3/VAR BTA 20431228 A	28/12/2043	V	38.440,66
TDA IBERCAJA 3, F.T.A.	ES0338452016	TDA.IBERCAJA.3/VAR BTA 20431228 B	28/12/2043	V	72.284,96
TDA IBERCAJA 4, F.T.A.	ES0338453006	TDA.IBERCAJA.4/VAR BTA 20440826 A1	26/08/2044	V	36.393,88
TDA PASTOR 1, F.T.A.	ES0377980000	TDA PASTOR 1/VAR BTA 20381228 A1	28/12/2038	V	1.816,91
VALENCIA HIPOTECARIO 3, F.T.A.	ES0382746016	VALENCIA.HIP.3/VAR BTA 20440922 A2	22/09/2044	V	44.005,57

CÉDULAS

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.	ES0414843146	CAIXAGALICIA/4.375 CEDHIP 20190123	23/01/2019	4,375	110.650,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211071	BBVA/4,00 CEDHIP 20250225 GTIA	25/02/2025	4,000	125.824,25
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211089	BBVA/3,50 CEDHIP 20150225 GTIA	25/02/2015	3,500	101.012,19
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211105	BBVA/3,50 CEDHIP 20201007 GTIA	07/10/2020	3,500	117.045,66
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211113	BBVA/3,25 CEDHIP 20160124 GTIA	24/01/2016	3,250	103.812,72
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211121	BBVA/3,50 CEDHIP 20210124 GTIA	24/01/2021	3,500	116.975,75
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211170	BBVA/4,25 CEDHIP 20170118 GTIA	18/01/2017	4,250	108.507,59
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211345	BBVA/3,625 CEDHIP 20170118 GTIA	18/01/2017	3,625	53.780,79
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211428	BBVA/4,75 CEDHIP 20160210 GTIA	10/02/2016	4,750	52.877,98
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211469	BBVA/4,25 CEDHIP 20150330 GTIA	30/03/2015	4,250	50.837,59
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211782	BBVA/3,50 CEDHIP 20171205 GTIA	05/12/2017	3,500	109.823,11
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211790	BBVA/3,875 CEDHIP 20230130 GTIA	30/01/2023	3,875	122.925,54
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211816	BBVA/2,25 CEDHIP 20240612 GTIA	12/06/2024	2,250	109.661,59
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA, S.A.	ES0415474305	CA.ESPAÑA/3,00 CEDHIP 20150603 GTIA	03/06/2015	3,000	1.001,73
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA, S.A.	ES0458673037	CA.ESP.DUERO/4,25 CEDHIP 20150430	30/04/2015	4,250	50.669,41
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860026	SAB/3,25 CEDHIP 20150615 GTIA	15/06/2015	3,250	101.975,89
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860034	SAB/3,50 CEDHIP 20160119 GTIA	19/01/2016	3,500	103.531,35
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860067	SAB/4,25 CEDHIP 20170124 GTIA	24/01/2017	4,250	108.189,38
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860281	SAB/3,625 CEDHIP 20150216 GTIA	16/02/2015	3,625	100.827,04
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860323	SAB/3,375 CEDHIP 20180123 GTIA	23/01/2018	3,375	109.142,14
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860380	SAB/VAR CEDHIP 20181126 GTIA	26/11/2018	V	100.000,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860398	SAB/0,875 CEDHIP 20211112 GTIA	12/11/2021	0,875	99.660,79
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0413056047	BMN/3,125 CEDHIP 20190121 GTIA	21/01/2019	3,125	110.165,90
BANCO PASTOR, S.A.U.	ES0405035009	BCO PASTOR/VAR CEDHIP 20280717 GTIA	17/07/2028	V	119.533,93
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413770001	PAS/3,75 CEDHIP 20150304 GTIA	04/03/2015	3,750	101.021,92
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790017	POP/4,00 CEDHIP 20161018 GTIA	18/10/2016	4,000	106.867,68
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790074	POP/4,125 CEDHIP 20180409 GTIA	09/04/2018	4,125	55.978,98
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790116	POP/4,25 CEDHIP 20150930 GTIA	30/09/2015	4,250	51.677,88
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790173	POP/4,125 CEDHIP 20170330 GTIA	30/03/2017	4,125	108.732,74
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790231	POP/3,75 CEDHIP 20190122 GTIA	22/01/2019	3,750	112.544,71
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790314	POP/3,50 CEDHIP 20170911 GTIA	11/09/2017	3,500	108.144,08
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790355	POP/2,125 CEDHIP 20191008 GTIA	08/10/2019	2,125	106.304,76
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440027	BTO/5,75 CEDHIP 20170327 GTIA	27/03/2017	5,750	112.648,20
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440068	BTO/3,50 CEDHIP 20150127 GTIA	27/01/2015	3,500	100.637,10
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440084	BTO/3,50 CEDHIP 20160118 GTIA	18/01/2016	3,500	103.631,29
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440175	BTO/3,625 CEDHIP 20150907 GTIA	07/09/2015	3,625	102.623,96
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440217	BTO/4,625 CEDHIP 20150330 GTIA	30/03/2015	4,625	101.603,11
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440266	BTO/3,75 CEDHIP 20160617 GTIA	17/06/2016	3,750	105.609,10
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440308	BTO/4,75 CEDHIP 20170124 GTIA	24/01/2017	4,750	109.919,62
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900061	SAN/4,50 CEDHIP 20160729 GTIA	29/07/2016	4,500	106.891,98
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900087	SAN/4,00 CEDHIP 20200407 GTIA	07/04/2020	4,000	118.623,28
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900103	SAN/3,125 CEDHIP 20150928 GTIA	28/09/2015	3,125	102.425,05
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900129	SAN/3,875 CEDHIP 20260206 GTIA	06/02/2026	3,875	125.658,82
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900145	SAN/4,125 CEDHIP 20170109 GTIA	09/01/2017	4,125	108.246,63
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900160	SAN/4,625 CEDHIP 20270504 GTIA	04/05/2027	4,625	135.199,49
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900202	SAN/3,125 CEDHIP 20150128 GTIA	28/01/2015	3,125	100.342,58
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900210	SAN/3,625 CEDHIP 20170406 GTIA	06/04/2017	3,625	107.985,01
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900228	SAN/4,625 CEDHIP 20160120 GTIA	20/01/2016	4,625	105.214,98
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900244	SAN/4,375 CEDHIP 20150316 GTIA	16/03/2015	4,375	101.297,09
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900251	SAN/4,625 CEDTER 20160621 GTIA	21/06/2016	4,625	107.023,56
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900285	SAN/3,25 CEDHIP 20150217 GTIA	17/02/2015	3,250	100.737,69
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900327	SAN/2,875 CEDHIP 20180130 GTIA	30/01/2018	2,875	108.198,23
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900368	SAN/1,125 CEDHIP 20241127 GTIA	27/11/2024	1,125	99.196,31
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900376	SAN/2,00 CEDHIP 20341127 GTIA	27/11/2034	2,000	99.356,32
BANKIA, S.A.	ES0414950560	CA.MADRID/5,75 CEDHIP 20160629 GTIA	29/06/2016	5,750	108.680,27
BANKIA, S.A.	ES0414950628	CA.MADRID/4,00 CEDHIP 20250203 GTIA	03/02/2025	4,000	121.152,28
BANKIA, S.A.	ES0414950636	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20151214 GTIA	14/12/2015	3,500	103.067,90
BANKIA, S.A.	ES0414950644	CA.MADRID/4,125 CEDHIP 20360324	24/03/2036	4,125	61.415,70
BANKIA, S.A.	ES0414950651	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20180525 GTIA	25/05/2018	4,250	56.273,10
BANKIA, S.A.	ES0414950669	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20160705 GTIA	05/07/2016	4,250	53.069,65
BANKIA, S.A.	ES0414950685	CA.MADRID/4,50 CEDHIP 20220426 GTIA	26/04/2022	4,500	61.871,35
BANKIA, S.A.	ES0414950693	CA.MADRID/5,00 CEDHIP 20190628 GTIA	28/06/2019	5,000	59.883,41
BANKIA, S.A.	ES0414950776	CA.MADRID/3,625 CEDHIP 20161005	05/10/2016	3,625	52.980,78
BANKIA, S.A.	ES0414977258	BANCAJA/4,375 CEDHIP 20150128 GTIA	28/01/2015	4,375	100.944,85
BANKINTER, S.A.	ES0413679178	BKT/4,125 CEDHIP 20170322 GTIA	22/03/2017	4,125	54.433,86
BANKINTER, S.A.	ES0413679202	BKT/3,875 CEDHIP 20151030 GTIA	30/10/2015	3,875	51.726,30
BANKINTER, S.A.	ES0413679269	BKT/2,75 CEDHIP 20160726 GTIA	26/07/2016	2,750	103.948,86
BANKINTER, S.A.	ES0413679277	BKT/3,125 CEDHIP 20180205 GTIA	05/02/2018	3,125	108.442,52
CAIXABANK, S.A.	ES0414970196	LACAIXA/4,75 CEDHIP 20181031 GTIA	31/10/2018	4,750	116.693,34
CAIXABANK, S.A.	ES0414970204	LACAIXA/3,875 CEDHIP 20250217 GTIA	17/02/2025	3,875	124.474,48
CAIXABANK, S.A.	ES0414970212	LACAIXA/3,25 CEDHIP 20151005 GTIA	05/10/2015	3,250	102.659,70
CAIXABANK, S.A.	ES0414970220	LACAIXA/VAR CEDHIP 20180109 GTIA	09/01/2018	V	98.950,86
CAIXABANK, S.A.	ES0414970246	LACAIXA/3,625 CEDHIP 20210118 GTIA	18/01/2021	3,625	58.801,02
CAIXABANK, S.A.	ES0414970253	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160630 GTIA	30/06/2016	V	981,45
CAIXABANK, S.A.	ES0414970295	LACAIXA/4,25 CEDHIP 20170126 GTIA	26/01/2017	4,250	54.326,22
CAIXABANK, S.A.	ES0414970303	LACAIXA/4,50 CEDHIP 20220126 GTIA	26/01/2022	4,500	62.519,96
CAIXABANK, S.A.	ES0414970337	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160930 GTIA	30/09/2016	V	982,23
CAIXABANK, S.A.	ES0414970352	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170330 GTIA	30/03/2017	V	983,12

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
CAIXABANK, S.A.	ES0414970378	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170320 GTIA	20/03/2017	V	49.985,18
CAIXABANK, S.A.	ES0414970394	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170930 GTIA	30/09/2017	V	980,29
CAIXABANK, S.A.	ES0414970402	LACAIXA/4,625 CEDHIP 20190604 GTIA	04/06/2019	4,625	59.234,60
CAIXABANK, S.A.	ES0414970535	LACAIXA/3,50 CEDHIP 20160331 GTIA	31/03/2016	3,500	52.233,44
CAIXABANK, S.A.	ES0414970659	LACAIXA/5,00 CEDHIP 20160222 GTIA	22/02/2016	5,000	53.054,09
CAIXABANK, S.A.	ES0414970667	LACAIXA/4,75 CEDHIP 20150318 GTIA	18/03/2015	4,750	50.732,04
CAIXABANK, S.A.	ES0414970683	LACAIXA/5,125 CEDHIP 20160427 GTIA	27/04/2016	5,125	53.451,85
CAIXABANK, S.A.	ES0440609040	CABK/4,00 CEDHIP 20170216 GTIA	16/02/2017	4,000	108.498,38
CAIXABANK, S.A.	ES0440609206	CABK/3,00 CEDHIP 20180322 GTIA	22/03/2018	3,000	108.678,62
CAIXABANK, S.A.	ES0440609248	CABK/2,625 CEDHIP 20240321 GTIA	21/03/2024	2,625	112.331,65
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0415306002	CR.NAVARRA/2,875 CEDHIP 20180611	11/06/2018	2,875	108.450,53
CAJAS RURALES UNIDAS, SOCIEDAD COOP. DE CREDITO	ES0422714016	CRU/3,375 CEDHIP 20160516 GTIA	16/05/2016	3,375	103.980,72
CAJAS RURALES UNIDAS, SOCIEDAD COOP. DE CREDITO	ES0422714024	CRU/3,75 CEDHIP 20181122 GTIA	22/11/2018	3,750	110.930,31
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0414840274	CA.CATALUNYA/3,50 CEDHIP 20160307	07/03/2016	3,500	103.714,97
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0414840308	CA.CATALUNYA/4,875 CEDHIP 20170629	29/06/2017	4,875	111.185,47
DEUTSCHE BANK, S.A.E.	ES0413320013	DT.BK.SAE/VAR CEDHIP 20170705 GTIA	05/07/2017	V	49.973,84
DEUTSCHE BANK, S.A.E.	ES0413320021	DT.BK.SAE/VAR CEDHIP 20190705 GTIA	05/07/2019	V	49.902,27
DEUTSCHE BANK, S.A.E.	ES0413320039	DT.BK.SAE/VAR CEDHIP 20220705 GTIA	05/07/2022	V	50.194,47
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0414954166	IBERCAJA/3,50 CEDHIP 20150422 GTIA	22/04/2015	3,500	50.702,00
KUTXABANK, S.A.	ES0414100059	BBK/4,55 CEDHIP 20200930 GTIA	30/09/2020	4,550	120.600,00
KUTXABANK, S.A.	ES0415309014	KUTXA/5,125 CEDHIP 20150408 GTIA	08/04/2015	5,125	51.044,37
KUTXABANK, S.A.	ES0443307014	KUTXABANK/3,00 CEDHIP 20170201 GTIA	01/02/2017	3,000	105.968,27
KUTXABANK, S.A.	ES0443307048	KUTXABANK/1,75 CEDHIP 20210527 GTIA	27/05/2021	1,750	106.214,97
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0413495005	SAN.CONS.FIN/3,875 CEDHIP 20160323	23/03/2016	3,875	104.871,29
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0458759000	UNICAJA/4,375 CEDHIP 20151014 GTIA	14/10/2015	4,375	51.897,65
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0458759034	UNICAJA/5,50 CEDHIP 20160323 GTIA	23/03/2016	5,500	53.457,30

PAGARÉS

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138625C5	SAB/PAG 20150304	04/03/2015	C	1.000,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138627Z2	SAB/PAG 20150114	14/01/2015	C	999,65
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862A09	SAB/PAG 20150513	13/05/2015	C	997,31
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862A74	SAB/PAG 20150603	03/06/2015	C	995,86
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862B73	SAB/PAG 20150617	17/06/2015	C	996,61
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862H44	SAB/PAG 20150923	23/09/2015	C	991,37
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862H77	SAB/PAG 20150930	30/09/2015	C	993,42
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862J59	SAB/PAG 20151028	28/10/2015	C	992,85
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862K72	SAB/PAG 20151125	25/11/2015	C	992,85
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862L22	SAB/PAG 20151202	02/12/2015	C	991,32
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806OK0	POP/PAG 20151016	16/10/2015	C	993,79
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806QW0	POP/PAG 20150212	12/02/2015	C	1.000,00
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806SI5	POP/PAG 20150508	08/05/2015	C	1.000,00
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900YJ2	SAN/PAG 20150108	08/01/2015	C	999,81
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900YL8	SAN/PAG 20150115	15/01/2015	C	999,93
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900YN4	SAN/PAG 20150303	03/03/2015	C	999,23
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900Y02	SAN/PAG 20150310	10/03/2015	C	999,51
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900YR5	SAN/PAG 20150202	02/02/2015	C	999,25
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900YT1	SAN/PAG 20150324	24/03/2015	C	999,01
BANKINTER SOCIEDAD DE FINANCIACION, S.A.	ES0513924292	BKT.SDAD.FIN/PAG 20150130	30/01/2015	C	999,65
BANKINTER, S.A.	ES0513679ZC4	BKT/PAG 20150121	21/01/2015	C	999,39
BANKINTER, S.A.	ES0513679ZE0	BKT/PAG 20150114	14/01/2015	C	999,67
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688CM3	BBVAF/PAG 20150109	09/01/2015	C	999,51
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688DM1	BBVAF/PAG 20150930	30/09/2015	C	994,54
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688DN9	BBVAF/PAG 20151002	02/10/2015	C	994,54
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688DO7	BBVAF/PAG 20151016	16/10/2015	C	994,54
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688DP4	BBVAF/PAG 20151019	19/10/2015	C	994,48
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688DR0	BBVAF/PAG 20150515	15/05/2015	C	997,97
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688DS8	BBVAF/PAG 20151119	19/11/2015	C	994,54
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688DT6	BBVAF/PAG 20150520	20/05/2015	C	998,03
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688DU4	BBVAF/PAG 20150126	26/01/2015	C	999,50
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688DV2	BBVAF/PAG 20150210	10/02/2015	C	999,55
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688DW0	BBVAF/PAG 20150304	04/03/2015	C	999,24
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688DX8	BBVAF/PAG 20150119	19/01/2015	C	999,75
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688DY6	BBVAF/PAG 20151218	18/12/2015	C	994,59
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688DZ3	BBVAF/PAG 20150225	25/02/2015	C	999,48
CAIXABANK, S.A.	ES05406097V2	CABK/PAG 20151201	01/12/2015	C	995,16
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060255L4	HIDROCANTABRICO/PAG 20150120	20/01/2015	C	99.856,75
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060255M2	HIDROCANTABRICO/PAG 20150216	16/02/2015	C	99.876,96
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060256H0	HIDROCANTABRICO/PAG 20150107	07/01/2015	C	99.861,06
IBERDROLA FINANZAS, S.A.U.	ES0505040008	IBE.FIN/PAG 20150123	23/01/2015	C	99.998,28
KUTXABANK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134247B4	KUTXA.EMPTOS/PAG 20150630	30/06/2015	C	99.755,82
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495JX5	SAN.CONS.FIN/PAG 20150731	31/07/2015	C	996,97
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495K02	SAN.CONS.FIN/PAG 20150424	24/04/2015	C	997,93
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495LS1	SAN.CONS.FIN/PAG 20150115	15/01/2015	C	99.963,14
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495LX1	SAN.CONS.FIN/PAG 20150123	23/01/2015	C	99.983,02
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495MF6	SAN.CONS.FIN/PAG 20150220	20/02/2015	C	99.942,00
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495MJ8	SAN.CONS.FIN/PAG 20150313	13/03/2015	C	100.000,00
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495MP5	SAN.CONS.FIN/PAG 20150320	20/03/2015	C	99.617,22
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495NC1	SAN.CONS.FIN/PAG 20150522	22/05/2015	C	99.838,97
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495NH0	SAN.CONS.FIN/PAG 20150630	30/06/2015	C	99.755,00
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495NU3	SAN.CONS.FIN/PAG 20151215	15/12/2015	C	99.585,18
SANTANDER SECURITIES SERVICES, S.A.	ES0513540J67	BBE/PAG 20150130	30/01/2015	C	999,77
SANTANDER SECURITIES SERVICES, S.A.	ES0513540J91	BBE/PAG 20150227	27/02/2015	C	999,74

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	24/02/2015	V	965,03
BANKINTER EMISIONES, S.A.U.	ES0113549002	BKT.EM/VAR NACU AMTB PPR I		V	48,19
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224001	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	98,88
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224027	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR B		V	98,88
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224043	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR C		V	98,88
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224050	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR D		V	98,88
BBVA INTERNATIONAL LIMITED	KYG090001119	BBVA.INTL/VAR NACU AMTB PPR F		V	98,88
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL LTD.	KYG171511172	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	872,71
CAIXA TERRASSA, SOCIETAT DE PARTICIPATIONS PREFERENTS, S.A.U.	KYG175491094	TERRASSA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	800,27
CAIXASABADELL PREFERENTS, S.A.U.	ES0101339028	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	38.568,31
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA PART. PREFERENTES, S.A.U.	ES0157085004	GUADALAJARA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	75.000,00
CAM CAPITAL, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0114607007	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR C	24/02/2015	V	1.002,45
CAM CAPITAL, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	KYG1793R1020	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR A	24/02/2015	V	475,20
CAM CAPITAL, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	KYG1793R1103	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR B	24/02/2015	V	475,20
DEOLEO PREFERENTES, S.A.U.	ES0130124003	DEOLEO.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	30.893,08
GUIPUZCOANO CAPITAL, S.A.	ES0143561001	GUL.CAP/VAR NACU AMTB PPR I	24/02/2015	V	82,79
GUIPUZCOANO CAPITAL, S.A.	ES0143561043	GUL.CAP/VAR NACU AMTB PPR III	19/02/2015	V	100,45
PASTOR PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.U.	ES0168569004	PASTOR.PREF/VAR NACU AMTB PPR 1		V	100,22
POPULAR CAPITAL, S.A.	ES0170412003	POP.CAP/VAR NACU AMTB PPR D		V	94,95
SABADELL INTERNATIONAL EQUITY, LTD	KYG773751063	SAB.INTL.EQ/VAR NACU AMTB PPR A	24/02/2015	V	390,15
SOL MELIA FINANCE LIMITED	KYG8259W1033	SOL.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	95,53
UNION FENOSA FINANCIAL SERVICES USA, L.L.C.	USU90716AA64	UNF.FINL.USA/VAR NACU AMTB PPR		V	24,80

RENTA VARIABLE

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Valor Medio en Euros
1NKEMIA IUCT GROUP, S.A.	ES0156303002	IKM/AC 0,10	1,66
AB-BIOTICS, S.A.	ES0109659013	AB-BIOTICS/AC 0,05	1,87
ABENGOA, S.A.	ES0105200002	ABG/AC B 0,01	2,63
ABENGOA, S.A.	ES0105200416	ABG/AC A 1,00	2,88
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0111845014	ABE/AC 3,00	16,00
ACCIONA, S.A.	ES0125220311	ANA/AC 1,00	55,61
ACERINOX, S.A.	ES0132105018	ACX/AC 0,25	11,72
ACS, ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS, S.A.	ES0167050915	ACS/AC 0,50	28,52
ADOLFO DOMINGUEZ, S.A.	ES0106000013	ADZ/AC 0,60	4,34
ADVEO GROUP INTERNATIONAL, S.A.	ES0182045312	ADVI/AC 1,50	12,45
AGROFRUSE-MEDITERRANEAN AGRICULTURAL GROUP, S.A.	ES0106325014	AGROFRUSE/AC 3,01	9,25
AIRBUS GROUP, N.V.	NL0000235190	AC, AIRBUS	46,06
ALFA, S.A.B. DE C.V.	MXP000511016	AC, ALFA S/A	2,21
ALMIRALL, S.A.	ES0157097017	ALMI/AC 0,12	12,75
ALTIA CONSULTORES, S.A.	ES0113312005	ALTIA,CONSULT/AC 0,02	8,00
AMADEUS IT HOLDING, S.A.	ES0109067019	AMS/AC A 0,01	29,90
AMERICA MOVIL, S.A.B. DE C.V.	MXP001691213	AC, AMERICA MOVIL, S/L	0,93
AMPER, S.A.	ES0109260531	AMP/AC 0,05	0,57
APERAM SOCIETE ANONYME	LU0569974404	APAM/AC SVN	22,94
APPLUS SERVICES, S.A.	ES0105022000	APPS/AC 0,10	9,63
ARCELORMITTAL, S.A.	LU0323134006	ARCELORMITTAL/AC SVN	9,74
ATRESMEDIA CORPORACION DE MEDIOS DE COMUNICACION, S.A.	ES0109427734	A3M/AC A 0,75	11,36
AXIA REAL ESTATE SOCIMI, S.A.	ES0105026001	AXIA/AC 10,00	9,89
AZKOYEN, S.A.	ES0112458312	AZK/AC 0,60	1,92
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0113211835	BBVA/AC 0,49	8,61
BANCO BRADESCO, S.A.	BRBBDACACNPR8	AC, BANCO BRADESCO -PREF.-	11,48
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0113860A34	SAB/AC 0,125	2,22
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0113790226	POP/AC 0,50	4,48
BANCO SANTANDER RIO, S.A.	ARBRI0010194	AC, BCO SANTANDER RIO, S/B	2,05
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0113900J37	SAN/AC 0,50	7,01
BANKIA, S.A.	ES0113307021	BKIA/AC 1,00	1,35
BANKINTER, S.A.	ES0113679I37	BKT/AC 0,30	6,70
BARON DE LEY, S.A.	ES0114297015	BDL/AC 0,60	73,24
BAYER A.G.	DE0008AY0017	AC, BAYER	111,74
BBVA BANCO FRANCES, S.A.	ARP125991090	AC, BBVA BCO, FRANCES	3,72
BIOORGANIC RESEARCH AND SERVICES, S.A.	ES0184980003	BNT/AC 0,05	6,43
BIOSEARCH, S.A.	ES0172233118	BIO/AC 0,24	0,51
BODEGAS BILBAINAS, S.A.	ES0114930011	BODEGAS.BILB/AC 6,01	6,69
BODEGAS RIOJANAS, S.A.	ES0115002018	RIO/AC 0,75	4,41
BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOLES, SDAD HOLDING DE MDOS Y STMAS FIN., S.A.	ES0115056139	BME/AC 3,00	31,25
BRADESPAR, S.A.	BRBRAPACNOR5	AC, BRADESPAR	4,24
BRADESPAR, S.A.	BRBRAPACNPR2	AC, BRADESPAR -PREF.-	4,88
BRASKEM, S.A.	BRBRKMACNPA4	AC, BRASKEM -PREF.-	5,64
CAIXABANK, S.A.	ES0140609019	CABK/AC 1,00	4,40
CARBURES EUROPE, S.A.	ES0116162068	CARBURES/AC 0,17	5,47
CARTERA INDUSTRIAL REA, S.A.	ES0162292017	CART.IND.REA/AC 2,30	1,93
CATENON, S.A.	ES0112320009	CATENON/AC 0,02	1,03
CEMENTOS MOLINS, S.A.	ES0117360117	CEMENTOS.MOLINS/AC 0,30	7,50
CEMENTOS PORTLAND VALDERRIVAS, S.A.	ES0117390411	CPL/AC 1,50	4,07
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNOR6	AC, ELETROBRAS	1,90
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNBP7	AC, ELETROBRAS, PREF. S/B	2,68
CIE AUTOMOTIVE, S.A.	ES0105630315	CIE/AC 0,25	10,90
CLINICA BAVIERA, S.A.	ES0119037010	CBAV/AC 0,10	7,46
CODERE, S.A.	ES0119256115	CDR/AC 0,20	0,38
COMMCENTER, S.A.	ES0121071007	COMMCENTER/AC 0,50	1,73
COMPANHIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	BRCMIGACNPR3	AC, CEMIG -PREF.-	4,41
COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	BRCPLEACNPB9	AC, COPEL -PREF.-	10,81
COMPANÍA DE DISTRIBUCION INTEGRAL LOGISTA HOLDINGS, S.A.	ES0105027009	LOG/AC 0,20	14,74
CONSTRUCCIONES Y AUXILIAR DE FERROCARRILES, S.A.	ES0121975017	CAF/AC 3,01	267,22
CORPORACION FINANCIERA ALBA, S.A.	ES0117160111	ALB/AC 1,00	41,03
DEOLEO, S.A.	ES0110047919	OLE/AC 0,38	0,38
DINAMIA CAPITAL PRIVADO, SCR, S.A.	ES0126501131	DIN/AC 3,00	7,46
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION, S.A.	ES0126775032	DIA/AC 0,10	5,29
DOGI INTERNATIONAL FABRICS, S.A.	ES0126962002	DGI/AC 0,064	0,71
DURO FELGUERA, S.A.	ES0162600417	MDF/AC 0,50	3,61
EBIOS ENERGY, A.D.	BG1100025128	EBIOS ENERGY/AC 1,00	0,93
EBRO FOODS, S.A.	ES0112501012	EBRO/AC 0,60	14,32
EDREAMS ODIGE0, S.A.	LU1048328220	EDREAMS/AC 0,10	1,89
ELECNOR, S.A.	ES0129743318	ENO/AC 0,10	8,85
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD, S.A.	CLP3710M1090	AC, ENDESA CHILE	1,16
ENAGAS, S.A.	ES0130960018	ENG/AC 1,50	25,94
ENCE ENERGIA Y CELULOSA, S.A.	ES0130625512	ENC/AC 0,90	1,73
ENDESA, S.A.	ES0130670112	ELE/AC 1,20	19,77
ENEL GREEN POWER, S.P.A.	IT0004618465	EGPW/AC 0,20	1,84
ENERSIS, S.A.	CLP371861061	AC, ENERSIS	0,24
ENTRECAMPOS CUATRO, SOCIMI, S.A.	ES0131172001	ENTRECAMPOS 4/AC 0,898	1,92
ERCROS, S.A.	ES0125140A14	ECR/AC 0,30	0,44
ESPAÑOLA DE VIVIENDAS EN ALQUILER, CIA., S.A.	ES0132955016	CEVASA/AC 6,00	128,46

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Valor Medio en Euros
EUROCONSULT GROUP, S.A.	ES0105042008	EUROCONSULT/AC 0,20	1,82
EUROESPES, S.A.	ES0133421000	EUROESPES/AC 0,601012	0,59
EURONA WIRELESS TELECOM, S.A.	ES0133443004	EURONA.WIRELESS/AC 1,00	2,79
FACEPHI BIOMETRIA, S.A.	ES0105029005	FACE/AC 0,04	1,86
FAES FARMA, S.A.	ES0134950F36	FAE/AC 0,10	1,84
FERROVIAL, S.A.	ES0118900010	FER/AC 0,20	15,82
FERSA ENERGIAS RENOVABLES, S.A.	ES0136463017	FRS/AC 1,00	0,40
FLUIDRA, S.A.	ES0137650018	FDR/AC 1,00	2,76
FOMENTO DE CONSTRUCCIONES Y CONTRATAS, S.A.	ES0122060314	FCC/AC 1,00	13,76
FUNESPAÑA, S.A.	ES0140441017	FUN/AC 0,30	5,89
GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA, S.A.	ES0143416115	GAM/AC 0,17	7,82
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0116870314	GAS/AC 1,00	22,07
GENERAL DE ALQUILER DE MAQUINARIA, S.A.	ES0141571119	GALQ/AC 0,10	0,27
GERDAU, S.A.	BRGGBRACNPR8	AC. GERDAU -PREF.-	3,35
GRIFOLS, S.A.	ES0171996004	GRF/ACSVT B 0,10	27,66
GRIFOLS, S.A.	ES0171996012	GRF/AC A 0,50	32,79
GRIÑO ECOLOGIC, S.A.	ES0143328005	GRIÑO.ECOLOGIC/AC 0,02	2,49
GRUPO CATALANA OCCIDENTE, S.A.	ES0116920333	GCO/AC 0,30	23,62
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA, S.A.	COT13PA00086	AC. GRUPOSURA	14,80
GRUPO ELEKTRA, S.A. DE C.V.	MX01EL000003	AC. GRUPO ELEKTRA	28,84
GRUPO EMPRESARIAL SAN JOSE, S.A.	ES0180918015	GSJ/AC 0,03	0,78
GRUPO EZENTIS, S.A.	ES0172708234	EZE/AC 0,30	0,72
GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	MXP370711014	AC. BANORTE S/O	4,72
GRUPO MODELO, S.A.B. DE C.V.	MXP4833F1044	AC. GRUPO MODELO. S/IC	7,14
GRUPO TAVEX, S.A.	ES0108180219	TVX/AC 0,10	0,24
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS, S.A.	ES0105019006	HIS/AC 1,00	10,28
HOME MEAL REPLACEMENT, S.A.	ES0105049003	HOME MEAL/AC 0,13	2,01
IBERDROLA, S.A.	ES0144580Y14	IBE/AC 0,75	5,59
IBERPAPEL GESTION, S.A.	ES0147561015	IBG/AC 0,60	12,07
IMAGINARIUM, S.A.	ES0147791018	IMAGINARIUM/AC 0,03	1,25
INDRA SISTEMAS, S.A.	ES0118594417	IDR/AC A 0,20	8,86
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL, S.A.	ES0148396007	ITX/AC 0,03	22,24
INMOBILIARIA COLONIAL, S.A.	ES0139140042	COL/AC 0,25	0,55
INMOBILIARIA DEL SUR, S.A.	ES0154653911	ISUR/AC 2,00	6,94
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP, S.A.	ES0177542018	IAG/AC 0,50	5,27
INVERFIATC, S.A.	ES0143419317	INVERFIATC/AC 1,00	0,28
INYPISA INFORMES Y PROYECTOS, S.A.	ES0152768612	INY/AC 0,137	0,38
JAZZTEL, PLC.	GB000B5TMSF21	JAZ/AC 0,80	12,70
LABORATORIOS FARMACEUTICOS ROVI, S.A.	ES0157261019	ROVI/AC 0,06	8,99
LAR ESPAÑA REAL ESTATE SOCIMI, S.A.	ES0105015012	LRE/AC 2,00	9,10
LIBERBANK, S.A.	ES0168675009	LBK/AC 0,30	0,67
LIBERTAS 7, S.A.	ES0137998A12	LIBERTAS.7/AC 0,50	2,35
LINGOTES ESPECIALES, S.A.	ES0158480311	LGT/AC 1,00	4,03
LOGISTICA DE HIDROCARBUROS CLH, CIA., S.A.	ES0110480219	CLH/AC D 1,20	32,82
LUMAR NATURAL SEAFOOD, S.A.	ES0158746026	LUMAR/AC 1,00	3,03
MAPFRE, S.A.	ES0124244E34	MAP/AC 0,10	2,80
MASMOVIL IBERCOM, S.A.	ES0184696013	ICOM/AC 0,10	12,74
MEDCOM TECH, S.A.	ES0161857018	MEDCOM.TECH/AC 0,01	6,74
MEDIASET ESPAÑA COMUNICACION, S.A.	ES0152503035	TL5/AC 0,50	9,78
MELIA HOTELS INTERNATIONAL, S.A.	ES0176252718	MEL/AC 0,20	8,21
MERCAL INMUEBLES SOCIMI, S.A.	ES0105030003	YMEI/AC 6,01	32,57
MERLIN PROPERTIES, SOCIMI, S.A.	ES0105025003	MRL/AC 1,00	9,79
MIQUEL Y COSTAS & MIQUEL, S.A.	ES0164180012	MCM/AC 2,00	28,27
MONTEBALITO, S.A.	ES0116494016	MTB/AC 1,00	1,14
NATRA, S.A.	ES0165515117	NAT/AC 1,20	0,99
NATRACEUTICAL, S.A.	ES0165359011	NTC/AC 0,10	0,19
NEURON BIO, S.A.	ES0166198012	NEU/AC 1,00	1,25
NH HOTEL GROUP, S.A.	ES0161560018	NHH/AC 2,00	3,66
NICOLAS CORREA, S.A.	ES0166300212	NEA/AC 0,80	1,22
NPG TECHNOLOGY, S.A.	ES0105020004	NP/AC 0,05	1,93
OBRASCON HUARTE LAIN, S.A.	ES0142090317	OHL/AC 0,60	21,94
ONLY-APARTMENTS, S.A.	ES0105038006	ONL/AC 0,10	2,07
PAPELES Y CARTONES DE EUROPA, S.A.	ES0168561019	PAC/AC 2,00	3,94
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNOR9	AC. PETROBRAS	4,35
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNPR6	AC. PETROBRAS -PREF.-	4,59
PRIM, S.A.	ES0170884417	PRM/AC 0,25	6,19
PROMOCIONES RENTA Y MANTENIMIENTO, SOCIMI, S.A.	ES0171613005	PROMORENT/AC 2,00	1,05
PROMOTORA DE INFORMACIONES, S.A.	ES0171743117	PRS/AC A 0,10	0,23
PROSEGUR, CIA. DE SEGURIDAD, S.A.	ES0175438003	PSG/AC 0,06	4,69
QUABIT INMOBILIARIA, S.A.	ES0110944016	QBT/AC 0,01	0,08
REALIA BUSINESS, S.A.	ES0173980015	RLIA/AC 0,24	0,87
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0173093115	REE/AC 2,00	69,68
RENO DE MEDICI, S.P.A.	IT0001178299	AC. RENO DE MEDICI. S/A	0,28
RENTA 4 BANCO, S.A.	ES0173358039	R4/AC 0,45	5,26
RENTA CORPORACION REAL ESTATE, S.A.	ES0173365018	REN/AC 1,00	1,03
REPSOL, S.A.	ES0173516115	REP/AC 1,00	17,34
RONSA, S.A.	ES0174300014	RONSA/AC 60,10	49,00
SACYR, S.A.	ES0182870214	SYV/AC 1,00	3,35

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Valor Medio en Euros
SARE, S.A.B., DE C.V.	MX01SA030007	AC. SARE. S/B	0,02
SECUOYA GRUPO DE COMUNICACION, S.A.	ES0131703003	SECUOYA.COM/AC 0,0125	5,07
SOCIEDAD ANONIMA DAMM	ES0125690513	DAMM/AC 0,20	5,15
SOLARIA ENERGIA Y MEDIO AMBIENTE, S.A.	ES0165386014	SLR/AC 0,01	0,85
SOTOGRADE, S.A.	ES0138109014	STG/AC 0,60	4,45
TECNICAS REUNIDAS, S.A.	ES0178165017	TRE/AC 0,10	38,13
TECNOCOM, TELECOMUNICACIONES Y ENERGIA, S.A.	ES0147582B12	TEC/AC 0,50	1,33
TELEFONICA, S.A.	ES0178430E18	TEF/AC 1,00	12,12
TESTA INMUEBLES EN RENTA, S.A.	ES0170885018	TST/AC 6,00	15,88
TUBACEX, S.A.	ES0132945017	TUB/AC 0,45	3,47
TUBOS REUNIDOS, S.A.	ES0180850416	TRG/AC 0,10	2,11
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	3,19
URALITA, S.A.	ES0182170615	URA/AC 0,72	0,53
URBAR INGENIEROS, S.A.	ES0182484214	URBAR.ING/AC 0,50	0,50
URBAS GRUPO FINANCIERO, S.A.	ES0182280018	URBAS/AC 0,01	0,02
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNOR3	AC. USIMINAS	2,45
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNPA6	AC. USIMINAS -PREF.-	1,77
VALE, S.A.	BRVALEACNOR0	AC. VALE	7,52
VALE, S.A.	BRVALEACNPA3	AC. VALE. PREF. 6%	6,51
VIDRALA, S.A.	ES0183746314	VID/AC 1,02	33,73
VINICOLA DEL NORTE DE ESPAÑA, S.A., CIA.	ES0184140210	CUN/AC 0,24	16,71
VISCOFAN, S.A.	ES0184262212	VIS/AC 0,70	44,99
VOCENTO, S.A.	ES0114820113	VOC/AC 0,20	1,62
VOLCAN COMPAÑIA MINERA, S.A.A.	PEP848014202	AC. VOLCAN. PREF. S/B	0,23
VOUSSE CORP, S.A.	ES0176406009	VOUSSE/AC 0,01	0,01
ZARDOYA OTIS, S.A.	ES0184933812	ZOT/AC 0,10	8,96
ZELTIA, S.A.	ES0184940817	ZEL/AC 0,05	2,66

(*) ANCV: Agencia Nacional de Codificación de Valores

(**) V: Cupón Variable, C: Cupón Cero