

BASE DE DATOS DE Norma DEF.-

Referencia: NFL018361

ORDEN HFP/145/2017, de 20 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 2016, a efectos de la declaración del Impuesto sobre el Patrimonio del año 2016 y de la declaración informativa anual acerca de valores, seguros y rentas.

(BOE de 24 de febrero de 2017)

La Ley 48/2015, de 29 de octubre, de Presupuestos Generales del Estado para el año 2016, prorrogó durante dicho ejercicio la vigencia del Impuesto sobre el Patrimonio, restablecido con carácter temporal por el Real Decreto-ley 13/2011, de 16 de septiembre. El mencionado Real Decreto-ley 13/2011, de 16 de septiembre, obliga 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 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 cotización media correspondiente al cuarto trimestre de cada año.

La habilitación al Ministro de Economía y Hacienda anteriormente citada debe entenderse conferida en la actualidad al Ministro de Hacienda y Función Pública, de acuerdo con lo dispuesto en el Real Decreto 415/2016, de 3 de noviembre, por el que se reestructuran los departamentos ministeriales.

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 2016; la relación de valores negociados y su cotización, en el último trimestre del año, en el mercado de Deuda Pública en Anotaciones, 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 2016, anexas a esta Orden, a efectos de la declaración del Impuesto sobre el Patrimonio del ejercicio 2016 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, 20 de febrero de 2017. El Ministro de Hacienda y Función Pública, Cristóbal Montoro Romero.

ANEXO

Relación de valores o participaciones con su valor de negociación medio o de liquidación media relativa al cuarto trimestre de 2016, a efectos de la declaración del Impuesto sobre el Patrimonio del ejercicio 2016 y de lo previsto en 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 1.065/2007, de 27 de julio.

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 EXTREMADURA	ES0000099178	CC.AA.EXT/3,875 OBSEGR 20240314	14/03/2024	3,875	117,311
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000010263	CC.AA.MAD/4,30 OB 20260915	15/09/2026	4,300	123,369
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000010545	CC.AA.MAD/5,75 BO 20180201	01/02/2018	5,750	106,818
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000010586	CC.AA.MAD/2,875 OB 20190406	06/04/2019	2,875	106,020
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000010602	CC.AA.MAD/4,125 OB 20240521	21/05/2024	4,125	120,752
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000010644	CC.AA.MAD/2,875 OB 20230717	17/07/2023	2,875	110,050
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000010651	CC.AA.MAD/1,826 OB 20250430	30/04/2025	1,826	102,340
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000010677	CC.AA.MAD/2,08 OB 20300312	12/03/2030	2,080	98,654
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000010693	CC.AA.MAD/1,189 OB 20220508	08/05/2022	1,189	101,849
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000010768	CC.AA.MAD/0,997 OB 20240930	30/09/2024	0,997	99,399
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011868	ESTADO/6,00 OBSEGR 20290131	31/01/2029	6,000	151,022
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011876	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20290131	31/01/2029	C	82,065
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011918	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170131	31/01/2017	C	100,056
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011934	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20190131	31/01/2019	C	100,144
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011942	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20200131	31/01/2020	C	99,271
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011959	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20210131	31/01/2021	C	98,990
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011967	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20220131	31/01/2022	C	97,630
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011975	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20230131	31/01/2023	C	96,372
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011983	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20240131	31/01/2024	C	94,668
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011991	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20250131	31/01/2025	C	89,186
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012001	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20370131	31/01/2037	C	60,830
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012038	ESTADO/3,80 OBSEGR 20170131	31/01/2017	3,800	100,858
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000120M2	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20170131	31/01/2017	C	100,063
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000120N0	ESTADO/4,90 OBSEGR 20400730	30/07/2040	4,900	151,994
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000120O8	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20400730	30/07/2040	C	53,615
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121A5	ESTADO/4,10 OBSEGR 20180730	30/07/2018	4,100	107,049
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121F4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20180730	30/07/2018	C	100,325
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121G2	ESTADO/4,80 OBSEGR 20240131	31/01/2024	4,800	128,919
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121K4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20240131	31/01/2024	C	95,543
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121L2	ESTADO/4,60 OBSEGR 20190730	30/07/2019	4,600	112,945
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121O6	ESTADO/4,30 OBSEGR 20191031	31/10/2019	4,300	112,730
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121R9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20190730	30/07/2019	C	99,811
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121S7	ESTADO/4,70 OBSEGR 20410730	30/07/2041	4,700	145,931
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121V1	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20191031	31/10/2019	C	100,093
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122C9	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20191031	31/10/2019	C	100,051
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122D7	ESTADO/4,00 OBSEGR 20200430	30/04/2020	4,000	113,075
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122E5	ESTADO/4,65 OBSEGR 20250730	30/07/2025	4,650	127,913
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122I6	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20200430	30/04/2020	C	98,955
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122N6	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170430	30/04/2017	C	100,114
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122T3	ESTADO/4,85 OBSEGR 20201031	31/10/2020	4,850	119,176
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122V9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20410730	30/07/2041	C	53,611
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122Z0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20201031	31/10/2020	C	99,155
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123B9	ESTADO/5,50 OBSEGR 20210430	30/04/2021	5,500	124,004
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123C7	ESTADO/5,90 OBSEGR 20260730	30/07/2026	5,900	142,982
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123F0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20210430	30/04/2021	C	99,009
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123G8	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20210430	30/04/2021	C	98,591
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123K0	ESTADO/5,85 OBSEGR 20220131	31/01/2022	5,850	127,325
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123M4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20220131	31/01/2022	C	97,932
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123Q7	ESTADO/4,50 BOESTSEGR 20180131	31/01/2018	4,500	105,975
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123U9	ESTADO/5,40 OBSEGR 20230131 CAC	31/01/2023	5,400	129,544
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123X3	ESTADO/4,40 OBSEGR 20231031 CAC	31/10/2023	4,400	124,813
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012411	ESTADO/5,75 OBSEGR 20320730	30/07/2032	5,750	155,636
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124B7	ESTADO/3,75 BOESTSEGR 20181031 CAC	31/10/2018	3,750	107,343
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124C5	ESTADO/5,15 OBSEGR 20281031 CAC	31/10/2028	5,150	136,813
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124H4	ESTADO/5,15 OBSEGR 20441031 CAC	31/10/2044	5,150	154,883
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124I2	ESTADO/2,10 BOESTSEGR 20170430 CAC	30/04/2017	2,100	101,087
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124J0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20181031 CAC	31/10/2018	C	100,415
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124O0	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20181031 CAC	31/10/2018	C	100,307
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124P7	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20231031 CAC	31/10/2023	C	95,666
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124Q5	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20191031 CAC	31/10/2019	C	99,787
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124U7	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20231031 CAC	31/10/2023	C	94,952
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124V5	ESTADO/2,75 BOESTSEGR 20190430 CAC	30/04/2019	2,750	106,837
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124W3	ESTADO/3,80 OBSEGR 20240430 CAC	30/04/2024	3,800	119,478
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124X1	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20230131 CAC	31/01/2023	C	96,417
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000125I9	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20241031 CAC	31/10/2024	C	91,834
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000125N9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20170430 CAC	30/04/2017	C	100,146
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000125P4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20240430 CAC	30/04/2024	C	93,872

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012627	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170730	30/07/2017	C	100,174
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012635	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20180730	30/07/2018	C	100,180
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012643	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20190730	30/07/2019	C	100,000
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012650	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20200730	30/07/2020	C	98,830
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012692	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20240730	30/07/2024	C	90,580
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126A4	ESTADO/VAR OBESEGR 20241130 CAC	30/11/2024	V	114,392
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126B2	ESTADO/2,75 OBESEGR 20241031 CAC	31/10/2024	2,750	115,254
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126C0	ESTADO/1,40 BOESTSEGR 20200131 CAC	31/01/2020	1,400	103,930
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126D8	ESTADO/4,00 OBESEGR 20641031 CAC	31/10/2064	4,000	137,978
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126E6	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20441031 CAC	31/10/2044	C	54,674
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126G1	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20301031 CAC	31/10/2030	C	78,850
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126V0	ESTADO/0,50 BOESTSEGR 20171031 CAC	31/10/2017	0,500	100,731
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126W8	ESTADO/VAR BOESTSEGR 20191130 CAC	30/11/2019	V	104,038
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126X6	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20241031 CAC	31/10/2024	C	92,117
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126Z1	ESTADO/1,60 OBESEGR 20250430 CAC	30/04/2025	1,600	106,191
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012726	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20270730	30/07/2027	C	87,989
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012783	ESTADO/5,50 OBESEGR 20170730	30/07/2017	5,500	104,047
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000127A2	ESTADO/1,95 OBESEGR 20300730 CAC	30/07/2030	1,950	103,233
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000127B0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20200131 CAC	31/01/2020	C	99,200
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000127C8	ESTADO/VAR OBESEGR 20301130 CAC	30/11/2030	V	105,096
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000127D6	ESTADO/0,25 BOESTSEGR 20180430 CAC	30/04/2018	0,250	100,585
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000127E4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20250430 CAC	30/04/2025	C	92,378
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000127G9	ESTADO/2,15 OBESEGR 20251031 CAC	31/10/2025	2,150	106,286
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000127H7	ESTADO/1,15 BOESTSEGR 20200730 CAC	30/07/2020	1,150	103,270
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000127I5	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20200730 CAC	30/07/2020	C	98,944
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000127Z9	ESTADO/1,95 OBESEGR 20260430 CAC	30/04/2026	1,950	104,820
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012817	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20170730	30/07/2017	C	100,192
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000128A0	ESTADO/0,25 BOESTSEGR 20190131 CAC	31/01/2019	0,250	100,719
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000128B8	ESTADO/0,75 BOESTSEGR 20210730 CAC	30/07/2021	0,750	102,236
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000128C6	ESTADO/2,90 OBESEGR 20461031 CAC	31/10/2046	2,900	104,054
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000128D4	ESTADO/VAR OBESEGR 20211130 CAC	30/11/2021	V	103,889
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000128E2	ESTADO/3,45 OBESEGR 20660730 CAC	30/07/2066	3,450	118,723
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000128H5	ESTADO/1,30 OBESEGR 20261031 CAC	31/10/2026	1,300	98,828
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012932	ESTADO/4,20 OBESEGR 20370131	31/01/2037	4,200	135,947
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950E9	GENCAT/4,95 OB 20200211	11/02/2020	4,950	102,615
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095853	GENCAT/4,69 OB 20341028	28/10/2034	4,690	83,951
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095879	GENCAT/4,22 OB 20350426	26/04/2035	4,220	87,384
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095929	GENCAT/4,75 OB 20180604	04/06/2018	4,750	100,095

**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
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0255281109	ICF/4,54 OB 20190918	18/09/2019	4,540	104,516
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0255281158	ICF/3,75 OB 20190901	01/09/2019	3,750	102,500

LETRAS DEL TESORO

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01701207	ESTADO/ILT 20170120	20/01/2017	C	100,108
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01702171	ESTADO/ILT 20170217	17/02/2017	C	100,095
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01703104	ESTADO/ILT 20170310	10/03/2017	C	100,112
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01704078	ESTADO/ILT 20170407	07/04/2017	C	100,131
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01705125	ESTADO/ILT 20170512	12/05/2017	C	100,162
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01706164	ESTADO/ILT 20170616	16/06/2017	C	100,183
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01707147	ESTADO/ILT 20170714	14/07/2017	C	100,197
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01708186	ESTADO/ILT 20170818	18/08/2017	C	100,205
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01709150	ESTADO/ILT 20170915	15/09/2017	C	100,224
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01710133	ESTADO/ILT 20171013	13/10/2017	C	100,232
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01711172	ESTADO/ILT 20171117	17/11/2017	C	100,245
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01712089	ESTADO/ILT 20171208	08/12/2017	C	100,252

OBLIGACIONES

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Vajor Medio en Euros
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845203	ABE/4,375 OB 20200330	30/03/2020	4,375	114.463,43
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845211	ABE/5,125 OB 20170612	12/06/2017	5,125	51.347,62
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845252	ABE/4,75 OB 20191025	25/10/2019	4,750	113.713,33
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845260	ABE/3,75 OB 20230620	20/06/2023	3,750	118.811,48
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845294	ABE/2,50 OB 20250227	27/02/2025	2,500	111.275,09
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845302	ABE/1,375 OB 20260520	20/05/2026	1,375	102.621,40
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845310	ABE/1,00 OB 20270227	27/02/2027	1,000	97.285,54
ADIF-ALTA VELOCIDAD	ES0200002006	ADIF AV/1,875 OB 20250128	28/01/2025	1,875	106.825,89
ADIF-ALTA VELOCIDAD	ES0200002014	ADIF AV/1,875 OB 20220922	22/09/2022	1,875	106.558,48
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839164	AUDASA/4,85 OB 20180327 GTIA	27/03/2018	4,850	523,80
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839172	AUDASA/6,00 OB 20210531 GTIA	31/05/2021	6,000	575,86
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839180	AUDASA/5,75 OB 20220516 GTIA	16/05/2022	5,750	691,07
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839198	AUDASA/5,20 OB 20230626 GTIA	26/06/2023	5,200	570,95
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839206	AUDASA/4,75 OB 20200401 GTIA	01/04/2020	4,750	543,27
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839214	AUDASA/3,75 OB 20251214 GTIA	14/12/2025	3,750	533,95
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839222	AUDASA/3,15 OB 20260517 GTIA	17/05/2026	3,150	515,47
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211198	BBVA/2,92 OB 20200121	21/01/2020	2,920	107.106,91
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214973069	CA.SABADELL/VAR OB SUBD 20170215	15/02/2017	V	49.939,87
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214973077	CA.SABADELL/VAR OBSUBD 20240610	10/06/2024	V	1.015,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214974059	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20210809	09/08/2021	V	96.622,86
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214974075	CA.TERRASSA/VAR OBSUBD PERP		V	35.433,82
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860051	SAB/6,25 OBSUBD 20200426	26/04/2020	6,250	55.644,88
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0213056007	BMN/9,00 OBSUBD 20261109	09/11/2026	9,000	108.499,61
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790001	POP/1,900 OBSUBD 20191222	22/12/2019	V	48.363,78
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790019	POP/8,00 OBSUBD 20210729	29/07/2021	8,000	994,68
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790027	POP/8,25 OBSUBD 20211019	19/10/2021	8,250	996,67
BANKIA, S.A.	ES0213307004	BKIA/VAR OBSUBD 20240522	22/05/2024	V	100.394,86
BANKIA, S.A.	ES0214977144	BANCAJA/4,375 OB 20170214	14/02/2017	4,375	101.157,02
BANKINTER, S.A.	ES0213679170	BKT/VAR OB SUBD 20170316	16/03/2017	V	99.885,00
BANKINTER, S.A.	ES0213679196	BKT/6,375 OBSUBD 20190911	11/09/2019	6,375	57.376,85
BANKINTER, S.A.	ES02136791C4	BKT/VAR OBESTR 20190424 55	24/04/2019	V	1.285,37
BANKINTER, S.A.	ES02136791D2	BKT/VAR OBESTR 20190415 56	15/04/2019	V	2.624,72
BANKINTER, S.A.	ES02136791L5	BKT/VAR OBESTR 20190603 68	03/06/2019	V	1.273,63
BANKINTER, S.A.	ES02136794U0	BKT/VAR OBESTR 20191106 188	06/11/2019	V	2.626,69
BANKINTER, S.A.	ES0213679915	BKT/VAR OBESTR 20190114 CVII	14/01/2019	V	3.379,63
BANKINTER, S.A.	ES0213679E62	BKT/VAR OBESTR 20201016 181	16/10/2020	V	7.256,38
BANKINTER, S.A.	ES0213679G86	BKT/VAR OBESTR 20201211 209	11/12/2020	V	2.386,20
BANKINTER, S.A.	ES0213679N20	BKT/VAR OBESTR 20210513 52	13/05/2021	V	99.774,78
BANKINTER, S.A.	ES0213679N79	BKT/VAR OBESTR 20210610 59	10/06/2021	V	49.538,29
BANKINTER, S.A.	ES0213679O45	BKT/VAR OBESTR 20210708 72	08/07/2021	V	49.943,84
BANKINTER, S.A.	ES0213679S41	BKT/VAR OBESTR 20211202 129	02/12/2021	V	49.997,70
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0205067095	BBVA GM/VAR OBESTR 20220609 41	09/06/2022	V	24.429,61
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0205067145	BBVA GM/2,71 OBESTR 20220107 64	07/01/2022	2,710	10.002,500
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0205067152	BBVA GM/VAR OBESTR 20270106 65	06/01/2027	V	100.000,00
CAIXABANK, S.A.	ES0240609000	CABK/4,00 OBSUBD 20220209 I	09/02/2022	4,000	100,71
CAIXABANK, S.A.	ES0240609018	CABK/5,00 OBSUBD 20220209 II	09/02/2022	5,000	101,06
CAIXABANK, S.A.	ES0240609083	CABK/CUPCER OBESTR 20220318 II	18/03/2022	C	98.705,91
CAIXABANK, S.A.	ES0240609091	CABK/CUPCER OBESTR 20220506 36	06/05/2022	C	99.830,59
CANAL DE ISABEL II GESTION, S.A.	ES0205061007	CN ISABEL II/1,68 OB 20250226	26/02/2025	1,680	102.488,30
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICAS DE PRODUCTOS PETROLIFEROS	ES0224261018	CORES/4,50 OB 20180423	23/04/2018	4,500	106.646,85
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICAS DE PRODUCTOS PETROLIFEROS	ES0224261034	CORES/2,50 OB 20241016	16/10/2024	2,500	110.326,67
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICAS DE PRODUCTOS PETROLIFEROS	ES0224261042	CORES/1,50 OB 20221127	27/11/2022	1,500	105.621,88
CRITERIA CAIXA, S.A.	ES0205045000	CRITERIA/1,625 OB 20220421	21/04/2022	1,625	100.055,24
CRITERIA CAIXA, S.A.	ES0214970081	LACAIXA/7,50 OBSUBD 20170131	31/01/2017	7,500	1.014,32
EROSKI, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429004	EROSKI/VAR OBSUBD PERP		V	7,26
EROSKI, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429038	EROSKI/VAR OBSUBD PERP		V	5,67
EROSKI, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429046	EROSKI/VAR OBSUBD 20280201	01/02/2028	V	5,65
FERIA MUESTRARIO INTERNACIONAL DE VALENCIA	ES0236395036	FERIA.VAL/6,04 OB 20270610	10/06/2027	6,040	123.233,81
FERROVIAL EMISIONES, S.A.	ES0205032008	FER EMI/2,50 OB 20240715	15/07/2024	2,500	111.580,00
FERROVIAL EMISIONES, S.A.	ES0205032016	FER EMI/0,375 OB 20220914	14/09/2022	0,375	98.815,63
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0214954135	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20180420	20/04/2018	V	489,49
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0214954150	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20190425	25/04/2019	V	487,59
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0244251007	IBERCAJA.BCO/VAR OBSUBD 20250728	28/07/2025	V	94.500,84
LIBERBANK, S.A.	ES0268675008	LIBERBK/5,00 OBSUBD CONV 20180717 A	17/07/2018	5,000	2,36
LIBERBANK, S.A.	ES0268675016	LIBERBK/5,00 OBSUBD CONV 20180717 B	17/07/2018	5,000	2,45
LIBERBANK, S.A.	ES0268675024	LIBERBK/7,00 OBSUBD CONV 20180717 C	17/07/2018	7,000	8,06
MAPFRE, S.A.	ES0224244063	MAP/VAR OB SUBD 20370724	24/07/2037	V	51.333,98
MAPFRE, S.A.	ES0224244071	MAP/1,625 OB 20260519	19/05/2026	1,625	102.448,11
MINICENTRALES DOS, S.A.	ES0264101009	MINICENT.DOS/6,45 OB 20280414	14/04/2028	6,450	77.246,24
NATRA, S.A.	ES0265515009	NAT/CUPCER OB CONV 20230127	27/01/2023	C	308,24

BONOS

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
AUTO ABS SPANISH LOANS 2016, FONDO DE TITULIZACION	ES0305194005	AUTO A SP LN/IVAR BTA 20321231 A	31/12/2032	V	100.005,85
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR-LEONESA, S.A.	ES0311843009	AUCALSA/4,35 BO 20190609 GTIA	09/06/2019	4,350	531,97
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR-LEONESA, S.A.	ES0311843017	AUCALSA/2,90 BO 20210517 GTIA	17/05/2021	2,900	515,84
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298021	AYT.CCG/3,75 BTA 20221214 III GTIA	14/12/2022	3,750	118.442,37
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298039	AYT.CCG/IVAR BTA 20180222 IV GTIA	22/02/2018	V	100.041,19
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298054	AYT.CCG/4,00 BTA 20210324 VI GTIA	24/03/2021	4,000	115.798,08
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298070	AYT.CCG/4,25 BTA 20180614 VIII GTIA	14/06/2018	4,250	107.624,00
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298096	AYT.CCG/4,25 BTA 20231025 X GTIA	25/10/2023	4,250	124.663,30
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298112	AYT.CCG/4,00 BTA 20170321 XII GTIA	21/03/2017	4,000	101.250,54
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298120	AYT.CCG/4,75 BTA 20270525 XIII GTIA	25/05/2027	4,750	132.797,00
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298153	AYT.CCG/IVAR BTA 20171023 XVI GTIA	23/10/2017	V	100.007,64
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298245	AYT.CCG/4,50 BTA 20191202 XXV GTIA	02/12/2019	4,500	114.770,50
AYT CEDULAS CAJAS IX, F.T.A.	ES0312358015	AYT.CED.CA.IX/4,00 BTA 20200331 B	31/03/2020	4,000	112.168,77
AYT CEDULAS CAJAS V, F.T.A.	ES0370148019	AYT.CED.CA.V/4,75 BTA 20181204 B	04/12/2018	4,750	110.348,70
AYT CEDULAS CAJAS VIII, F.T.A.	ES0312362017	AYT.CED.CA.VIII/4,25 BTA 20191118 B	18/11/2019	4,250	112.025,42
AYT CEDULAS CAJAS X, F.T.A.	ES0312342019	AYT.CED.CA.X/3,75 BTA 20250630 B	30/06/2025	3,750	121.844,02
AYT DEUDA SUBORDINADA I, F.T.A.	ES0312284005	AYT DEU SUBD IVAR BTA 20191117 A	17/11/2019	V	9.271,58
AYT DEUDA SUBORDINADA I, F.T.A.	ES0312284013	AYT DEU SUBD IVAR BTA 20191117 B	17/11/2019	V	57.645,23
AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, F.T.H.	ES0370150007	AYT GENOVA HIP /VAR BTH 20360516 A	16/05/2036	V	20.904,18
AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, F.T.H.	ES0312300017	AYT GEN HIP IX/IVAR BTH 20390715 A2	15/07/2039	V	24.847,44
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, F.T.H.	ES0312343017	AYT GEN HIP VIII/IVAR BTH 20380915 A2	15/09/2038	V	19.695,83
AYT HIPOTECARIO IV, F.T.H.	ES0312370002	AYT HIP IV/IVAR BTH 20330613 A GTIA	13/06/2033	V	5.847,20
AYT HIPOTECARIO MIXTO II, F.T.A.	ES0370151005	AYT.HIP.MIX.II/IVAR BTA 20360620 PH1	20/06/2036	V	13.383,18
AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, F.T.A.	ES0370152003	AYT.HIP.MIX.IV/IVAR BTA 20400120 A	20/01/2040	V	21.385,44
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, F.T.A.	ES0370154009	KUTXA.HIP.II/IVAR BTA 20561015 A	15/10/2056	V	42.152,27
AYT.11, F.T.H.	ES0338541008	AYT 11/IVAR BTH 20351015 A GTIA	15/10/2035	V	8.910,49
BANCAJA 10, F.T.A.	ES0312872015	BANCAJA10/IVAR BTA 20500522 A2 GTIA	22/05/2050	V	29.549,94
BANCAJA 10, F.T.A.	ES0312872023	BANCAJA10/IVAR BTA 20500522 A3 GTIA	22/05/2050	V	97.199,77
BANCAJA 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312885017	BANCAJA.6/IVAR BTA 20360220 A2 GTIA	20/02/2036	V	12.661,24
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211107	BBVA/IVAR BO 20181125 NOV16	25/11/2018	V	100.020,45
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211908	BBVA/2,20 BO 20171010	10/10/2017	2,200	101.729,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211916	BBVA/2,35 BO 20180316	16/03/2018	2,350	102.875,74
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313212021	BCO.CAM/4,50 BO 20170309 GTIA	09/03/2017	4,500	50.300,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138601Y5	SAB/0,75 BO 20170116	16/01/2017	0,750	998,84
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138602A3	SAB/0,75 BO 20170526	26/05/2017	0,750	998,75
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138602B1	SAB/0,75 BO 20170503	03/05/2017	0,750	999,69
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138602E5	SAB/0,65 BO 20170705	05/07/2017	0,650	999,39
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138602G0	SAB/0,60 BO 20180614	14/06/2018	0,600	999,14
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138602J4	SAB/0,50 BO 20180726	26/07/2018	0,500	998,65
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138602Q4	SAB/0,40 BO 20180620 IV	20/09/2018	0,400	999,05
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138602P1	SAB/0,65 BO 20200305 V	05/03/2020	0,650	1.000,05
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138602Q9	SAB/IVAR BOESTR 20211130 15	30/11/2021	V	100.000,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138602R7	SAB/IVAR BO 20191212 7	12/12/2019	V	100.000,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138602S5	SAB/0,30 BO 20180629	29/06/2018	0,300	100.000,00
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0313900419	SAN/IVAR BOINT 20201214	22/12/2020	V	143.595,63
BANKIA, S.A.	ES0313307003	BKIA/3,50 BO 20190117	17/01/2019	3,500	106.761,57
BANKIA, S.A.	ES0313307185	BKIA/1,50 BO 20171009	09/10/2017	1,500	101.356,76
BANKIA, S.A.	ES0313307193	BKIA/1,50 BO 20171110	10/11/2017	1,500	10.107,16
BANKINTER 11, F.T.H.	ES0313714018	BKT 11/IVAR BTH 20480821 A2	21/08/2048	V	32.892,08
BANKINTER 3, F.T.H.	ES0314019003	BKT 3/IVAR BTH 20381016 A GTIA	16/10/2038	V	7.742,33
BANKINTER 9, F.T.A.	ES0313814016	BKT.9/IVAR BTA 20420716 A2P GTIA	16/07/2042	V	26.398,33
BANKINTER, S.A.	ES03136793B0	BKT/1,75 BO 20190610	10/06/2019	1,750	104.237,75
BANKINTER, S.A.	ES03136796P3	BKT/CUPCER BOESTR 20180226 21	26/02/2018	C	51.795,57
BANKINTER, S.A.	ES03136797L0	BKT/IVAR BOESTR 20190916 92	16/09/2019	V	27.296,04
BANKINTER, S.A.	ES03136797R7	BKT/IVAR BOESTR 20181005 115	05/10/2018	V	89.086,70
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067128	BBVA GM/IVAR BOESTR 20180529 29	29/05/2018	V	96.949,48
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067292	BBVA GM/IVAR BOESTR 20190603 39	03/06/2019	V	97.651,88
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067318	BBVA GM/IVAR BOESTR 20171211 42	11/12/2017	V	24.301,80
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067391	BBVA GM/IVAR BOESTR 20210712 53	12/07/2021	V	97.804,66
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067433	BBVA GM/1,54 BOESTR 20211018 57	18/10/2021	1,540	10.002,50
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067474	BBVA GM/0,50 BOESTR 20171009 61	08/10/2017	0,500	100.000,00
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067490	BBVA GM/0,50 BOESTR 20171110 66	09/01/2017	0,500	100.000,00
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067516	BBVA GM/IVAR BOESTR 20191118 68	18/11/2019	V	100.100,17
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067532	BBVA GM/IVAR BOESTR 20180523 70	23/05/2018	V	100.000,00
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067565	BBVA GM/0,50 BOESTR 20161205 73	12/01/2017	0,500	100.000,00
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067573	BBVA GM/0,50 BOESTR 20171212 74	12/01/2017	0,500	100.000,00
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067581	BBVA GM/0,50 BOESTR 20171219 75	19/01/2017	0,500	100.000,00
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067599	BBVA GM/0,50 BOESTR 20171222 76	23/01/2017	0,500	100.000,00
CAIXA PENEDES 1 TDA, F.T.A.	ES0313252001	CA.PENEDES1.TDA/IVAR BTA 20430128 A	28/01/2043	V	29.180,42
CAIXABANK, S.A.	ES0340609199	CABK/3,125 BO 20180514	14/05/2018	3,125	104.757,54
CAIXABANK, S.A.	ES0340609215	CABK/2,50 BO 20170418	18/04/2017	2,500	101.071,30
CAIXABANK, S.A.	ES0340609736	CABK/CUPCER BOESTR 20200619 I	19/06/2020	C	94.475,61
CAIXABANK, S.A.	ES0340609744	CABK/CUPCER BOESTR 20200731	31/07/2020	C	92.168,44
CAIXABANK, S.A.	ES0340609751	CABK/CUPCER BOESTR 20181023 I	23/10/2018	C	91.816,86
CAIXABANK, S.A.	ES0340609769	CABK/CUPCER BOESTR 20200205 I	05/02/2020	C	99.510,04
CAIXABANK, S.A.	ES0340609777	CABK/IVAR BOESTR 20190318 I	18/03/2019	V	99.715,40
CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, F.T.A.	ES0318822006	CED.POP.3/4,25 BTA 20170426 GTIA	26/04/2017	4,250	101.520,20
CEDULAS TDA 5, F.T.A.	ES0317045005	CED.TDA.5/4,13 BTA 20191129 A GTIA	29/11/2019	4,125	113.093,73
CEDULAS TDA 6, F.T.A.	ES0317046003	CED.TDA.6/3,88 BTA 20250523 GTIA	23/05/2025	3,875	126.639,57
CEDULAS TDA 7, F.T.A.	ES0317047001	CED.TDA.7/3,50 BTA 20170620 GTIA	20/06/2017	3,500	101.806,09
CRITERIA CAIXA, S.A.	ES0314970239	LACAIXA/2,375 BO 20190509	09/05/2019	2,375	104.935,34
DRIVER ESPAÑA THREE, FONDO DE TITULIZACION	ES0305116008	DRIVER THREE/IVAR BTA 20261221 A	21/12/2026	V	66.022,34
DRIVER ESPAÑA TWO, F.T.	ES0305094007	DRIVER TWO/IVAR BTA 20260821 A GTIA	21/08/2026	V	54.316,95
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014104	EMISORA SAN/IVAR BOESTR 20190710 14	10/07/2019	V	1.007,04
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014179	EMISORA SAN/IVAR BOESTR 20171030 25	30/10/2017	V	958,40
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014237	EMISORA SAN/IVAR BOESTR 20171124 33	24/11/2017	V	955,82
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014369	EMISORA SAN/IVAR BOESTR 20200212 43	12/02/2020	V	993,05
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014377	EMISORA SAN/IVAR BOESTR 20180205 42	05/02/2018	V	956,14
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014393	EMISORA SAN/IVAR BOESTR 20200416 46	16/04/2020	V	997,36
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014401	EMISORA SAN/IVAR BOESTR 20190401 45	01/04/2019	V	926,43
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014419	EMISORA SAN/IVAR BOESTR 20180514 47	14/05/2018	V	959,95
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014427	EMISORA SAN/IVAR BOESTR 20200527 48	27/05/2020	V	989,78

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014435	EMISORA SANVAR BOESTR 20180806 50	08/08/2018	V	1.013,42
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014443	EMISORA SANVAR BOESTR 20180917 51	17/09/2018	V	1.015,27
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014450	EMISORA SANVAR BOESTR 20181029 52	29/10/2018	V	1.002,47
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014468	EMISORA SANVAR BOESTR 20181203 53	03/12/2018	V	1.007,28
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014476	EMISORA SANVAR BOESTR 20190128 54	28/01/2019	V	1.001,69
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014492	EMISORA SANVAR BOESTR 20210504 56	04/05/2021	V	1.004,07
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014500	EMISORA SANVAR BOESTR 20210615 57	15/06/2021	V	1.016,73
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014518	EMISORA SANVAR BOESTR 20210727 58	27/07/2021	V	999,35
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014526	EMISORA SANVAR BOESTR 20210826 59	26/08/2021	V	999,00
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014534	EMISORA SANVAR BOESTR 20190930 60	30/09/2019	V	1.013,50
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014542	EMISORA SANVAR BOESTR 20210930 61	30/09/2021	V	996,98
F.T.A. PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZACION DE CEDULAS HIPOTECARIAS	ES0334899008	PRG IND.CED.HIP/5,125 BTA 20220720	20/07/2022	5,125	129.306,31
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS RMBS PRADO 1	ES0305073001	RMBS PRADO 1/VAR BTA 20550615 GTIA	15/06/2055	V	84.357,49
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 11	ES0338340005	UCI.11/VAR BTA 20410915 A GTIA	15/09/2041	V	18.095,31
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 11	ES0338340013	UCI.11/VAR BTA 20410915 B GTIA	15/09/2041	V	81.744,57
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 16	ES0338186010	UCI.16/VAR BTA 20490616 A2 GTIA	16/06/2049	V	42.838,38
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 8	ES0338446000	UCI.8/VAR BTA 20331218 A GTIA	18/12/2033	V	8.965,91
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 9	ES0338222005	UCI.9/VAR BTA 20350619 A GTIA	19/06/2035	V	12.051,03
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, UCI 15	ES0380957003	UCI.15/VAR BTA 20481218 A GTIA	18/12/2048	V	30.324,46
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641023	FADE/5,90 BTA 20210317 3 GTIA	17/03/2021	5,900	123.486,42
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641031	FADE/5,60 BTA 20180917 4 GTIA	17/09/2018	5,600	110.272,09
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641056	FADE/5,00 BTA 20261217 6 GTIA	17/12/2026	5,000	128.058,56
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641080	FADE/6,25 BTA 20250317 9 GTIA	17/03/2025	6,250	140.450,93
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641114	FADE/4,875 BTA 20171217 12 GTIA	17/12/2017	4,875	105.034,90
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641130	FADE/4,125 BTA 20170317 14 GTIA	17/03/2017	4,125	101.514,37
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641155	FADE/3,875 BTA 20180317 16 GTIA	17/03/2018	3,875	105.242,12
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641171	FADE/3,375 BTA 20190317 18 GTIA	17/03/2019	3,375	107.687,17
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641197	FADE/1,875 BTA 20170917 20 GTIA	17/09/2017	1,875	101.649,85
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641205	FADE/0,85 BTA 20190917 21 GTIA	17/09/2019	0,850	101.866,94
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641239	FADE/0,50 BTA 20201217 24 GTIA	17/12/2020	0,500	101.687,24
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641254	FADE/0,125 BTA 20210917 25 GTIA	17/09/2021	0,125	99.672,00
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641262	FADE/0,00 BTA 20191217 27 GTIA	17/12/2019	0,000	100.004,36
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641270	FADE/0,75 BTA 20240317 28 GTIA	17/03/2024	0,750	99.570,71
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 10	ES0338146006	UCI 10/VAR BTH 20360622 A GTIA	22/06/2036	V	15.917,56
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 12	ES0338147004	UCI 12/VAR BTH 20391215 A GTIA	15/12/2039	V	25.408,65
FT RMBS PRADO II	ES0305123004	RMBS PRADO II/VAR BTA 20520317 A	17/03/2052	V	91.786,14
FTPYME TDA CAM 4, F.T.A.	ES0339759013	PYME.TDA.CAM.4/VAR BTA 20450928 A2	28/09/2045	V	2.844,21
GC SABADELL 1, F.T.H.	ES0316874017	GC SAB 1/VAR BTH 20380620 A2	20/06/2038	V	17.672,23
HIPOCAT 7, F.T.A.	ES0345783023	HIPOCAT 7/VAR BTA 20360715 B GTIA	15/07/2036	V	58.858,50
IM CAJA LABORAL 1, F.T.A.	ES0347565006	IM.CA.LABORAL.1/VAR BTA 20491024 A	24/10/2049	V	29.889,51
IM CAJAMAR 1, F.T.A.	ES0347851000	IM CAJAMAR 1/VAR BTA 20380124 A	24/01/2038	V	16.405,99
IM CAJAMAR 3, F.T.A.	ES0347830005	IM CAJAMAR 3/VAR BTA 20480922 A	22/09/2048	V	28.495,63
IM CEDULAS 10, F.T.A.	ES0349045007	IM.CED.10.4,50 BTA 20220221 GTIA	21/02/2022	4,500	122.990,00
IM CEDULAS 5, F.T.A.	ES0347849004	IM CEDULAS 5/3,50 BTA 20200615 GTIA	15/06/2020	3,500	112.321,02
IM CEDULAS 7, F.T.A.	ES0347844003	IM.CED.7.4,00 BTA 20210331 GTIA	31/03/2021	4,000	116.889,00
IM PASTOR 2, F.T.H.	ES0347861009	IM PASTOR 2/VAR BTH 20410922 A	22/09/2041	V	11.555,25
MADRID RMBS III, F.T.A.	ES0359093020	MADRID.RMBS.III/VAR BTA 20500222 A3	22/02/2050	V	100.000,00
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622012	PROG.CED.TDA/4,13 BTA 20210410 A4	10/04/2021	4,125	116.345,71
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622020	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20310410 A6	10/04/2031	4,250	136.736,46
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622038	PROG.CED.TDA/4,00 BTA 20181023 A3	23/10/2018	4,000	108.530,30
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622046	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20270328 A5	28/03/2027	4,250	132.418,71
RMBS PRADO III, F.T.A.	ES0305192009	RMBS PRADO III/VAR BTA 20560315	15/03/2056	V	100.004,22
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, F.T.A.	ES0374273003	RURAL.HIP.GBL.I/VAR BTA 20390118 A	18/01/2039	V	19.415,53
RURAL HIPOTECARIO IX, F.T.A.	ES0374274027	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 A3	17/02/2050	V	90.217,14
RURAL HIPOTECARIO V, F.T.H.	ES0358284000	RURAL.HIP.V/VAR BTH 20350315 A1	15/03/2035	V	16.253,67
SACYR, S.A.	ES0382870006	SYV/4,50 B0 20200507	07/05/2020	4,500	100.000,00
SANTANDER CONSUMO 2, F.T.	ES0305193031	SAN CONS 2/12,50 BTA 20350509 F	18/04/2031	12,500	100.000,00
SANTANDER CONSUMO 2, F.T.	ES0305193049	SAN CONS 2/5,50 BTA 20350509 D GTIA	18/04/2031	5,500	100.000,00
SANTANDER CONSUMO 2, F.T.	ES0305193056	SAN CONS 2/6,00 BTA 20350509 E GTIA	18/04/2031	6,000	100.000,00
SOCIEDAD DE GESTION DE ACTIVOS PROC. DE LA REESTR. BANCARIA, S.A.	ES0352506119	SAREB/VAR BO 20170228 2015-2	28/02/2017	V	100.000,00
SOCIEDAD DE GESTION DE ACTIVOS PROC. DE LA REESTR. BANCARIA, S.A.	ES0352506143	SAREB/VAR BO 20170228 2016-1	28/02/2017	V	100.000,00
SOCIEDAD DE GESTION DE ACTIVOS PROC. DE LA REESTR. BANCARIA, S.A.	ES0352506150	SAREB/VAR BO 20190228 2016-2	28/02/2019	V	99.992,14
SRF 2016-1, F.T.	ES0305177000	SRF 2016-1/VAR BTA 20640426 A GTIA	26/04/2064	V	99.999,36
SRF 2016-1, F.T.	ES0305177018	SRF 2016-1/VAR BTA 20640426 B GTIA	26/04/2064	V	100.000,00
SRF 2016-1, F.T.	ES0305177026	SRF 2016-1/VAR BTA 20640426 C GTIA	26/04/2064	V	100.000,00
TDA 19-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377964004	TDA 19-MIXTO/VAR BTA 20360322 A	22/03/2036	V	15.268,49
TDA 20-MIXTO, F.T.A.	ES0377981024	TDA.20-MIX/VAR BTA 20360426 A2 GTIA	26/04/2036	V	12.234,22
TDA 20-MIXTO, F.T.A.	ES0377981032	TDA.20-MIX/VAR BTA 20360426 B2 GTIA	26/04/2036	V	87.366,67
TDA CAM 4, F.T.A.	ES0377991007	TDA.CAM.4/VAR BTA 20390626 A GTIA	26/06/2039	V	16.267,25
TDA CAM 5, F.T.A.	ES0377992005	TDA.CAM.5/VAR BTA 20431026 A GTIA	26/10/2043	V	26.405,31
TDA CAM 8, F.T.A.	ES0377966009	TDA.CAM.8/VAR BTA 20490226 A GTIA	29/02/2049	V	29.880,52
TDA CAM 9, F.T.A.	ES0377955010	TDA.CAM.9/VAR BTA 20500428 A2 GTIA	28/04/2050	V	29.809,54
TDA IBERCAJA 1, F.T.A.	ES0338450002	TDA IBERCAJA 1/VAR BTA 20350726 A	28/07/2035	V	14.900,23

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	109.348,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211071	BBVA/4,00 CEDHIP 20250225 GTIA	25/02/2025	4,000	128.541,30
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211105	BBVA/3,50 CEDHIP 20201007 GTIA	07/10/2020	3,500	113.615,55
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211121	BBVA/3,50 CEDHIP 20210124 GTIA	24/01/2021	3,500	115.200,58
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211170	BBVA/4,25 CEDHIP 20170118 GTIA	18/01/2017	4,250	100.606,94
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211345	BBVA/3,625 CEDHIP 20170118 GTIA	18/01/2017	3,625	50.433,56
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211782	BBVA/3,50 CEDHIP 20171205 GTIA	05/12/2017	3,500	103.898,80
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211790	BBVA/3,875 CEDHIP 20230130 GTIA	30/01/2023	3,875	121.465,48
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211816	BBVA/2,25 CEDHIP 20240612 GTIA	12/06/2024	2,250	111.640,01
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211824	BBVA/0,75 CEDHIP 20220120 GTIA	20/01/2022	0,750	103.732,77
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211865	BBVA/0,625 CEDHIP 20210517 GTIA	17/05/2021	0,625	103.102,56
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211873	BBVA/0,625 CEDHIP 20230318 GTIA	18/03/2023	0,625	102.886,65
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211907	BBVA/VAR CEDTER 20211017 GTIA	17/10/2021	V	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211915	BBVA/VAR CEDHIP 20261122 GTIA	22/11/2026	V	99.320,71
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0414840308	CA.CATALUNYA/4,875 CEDHIP 20170629	29/06/2017	4,875	102.800,74
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860067	SAB/4,25 CEDHIP 20170124 GTIA	24/01/2017	4,250	100.729,60
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860323	SAB/3,375 CEDHIP 20180123 GTIA	23/01/2018	3,375	104.380,31
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860398	SAB/0,875 CEDHIP 20211112 GTIA	12/11/2021	0,875	103.233,47
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860455	SAB/0,375 CEDHIP 20200610 GTIA	10/06/2020	0,375	101.508,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860505	SAB/0,625 CEDHIP 20201103 GTIA	03/11/2020	0,625	102.448,65
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860547	SAB/0,625 CEDHIP 20240610 GTIA	10/06/2024	0,625	100.892,55
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860554	SAB/0,125 CEDHIP 20231020 GTIA	20/10/2023	0,125	99.620,10
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860562	SAB/VAR CEDHIP 20201215 GTIA	15/12/2020	V	100.000,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860570	SAB/VAR CEDHIP 20211221 GTIA	21/12/2021	V	100.000,00
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0413056047	BMN/3,125 CEDHIP 20190121 GTIA	21/01/2019	3,125	107.402,30
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790074	POP/4,125 CEDHIP 20180409 GTIA	09/04/2018	4,125	52.890,92
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790173	POP/4,125 CEDHIP 20170330 GTIA	30/03/2017	4,125	101.692,92
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790231	POP/3,75 CEDHIP 20190122 GTIA	22/01/2019	3,750	108.647,48
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790314	POP/3,50 CEDHIP 20170911 GTIA	11/09/2017	3,500	103.045,13
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790355	POP/2,125 CEDHIP 20191008 GTIA	08/10/2019	2,125	106.799,39
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790397	POP/1,00 CEDHIP 20250407 GTIA	07/04/2025	1,000	99.446,22
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790413	POP/0,75 CEDHIP 20200929 GTIA	29/09/2020	0,750	102.857,26
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790421	POP/0,875 CEDHIP 20210928 GTIA	28/09/2021	0,875	102.742,13
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790439	POP/1,00 CEDHIP 20220303 GTIA	03/03/2022	1,000	102.214,47
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440027	BTO/5,75 CEDHIP 20170327 GTIA	27/03/2017	5,750	102.655,97
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440308	BTO/4,75 CEDHIP 20170124 GTIA	24/01/2017	4,750	100.693,15
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900087	SAN/4,00 CEDHIP 20200407 GTIA	07/04/2020	4,000	114.531,68
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900129	SAN/3,875 CEDHIP 20260206 GTIA	06/02/2026	3,875	124.854,82
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900145	SAN/4,125 CEDHIP 20170109 GTIA	09/01/2017	4,125	100.665,65
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900160	SAN/4,625 CEDHIP 20270504 GTIA	04/05/2027	4,625	134.767,26
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900327	SAN/2,875 CEDHIP 20180130 GTIA	30/01/2018	2,875	103.804,39
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900368	SAN/1,125 CEDHIP 20241127 GTIA	27/11/2024	1,125	103.572,96
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900376	SAN/2,00 CEDHIP 20341127 GTIA	27/11/2034	2,000	114.698,19
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900384	SAN/0,75 CEDHIP 20220909 GTIA	09/09/2022	0,750	102.556,31
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900392	SAN/1,50 CEDHIP 20260125 GTIA	25/01/2026	1,500	108.602,46
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900400	SAN/2,038 CEDHIP 20360229 GTIA	29/02/2036	2,038	113.430,00
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900467	SAN/0,45 CEDHIP 20211220 GTIA	20/12/2021	0,450	100.000,00
BANKIA, S.A.	ES0413307093	BKIA/1,00 CEDHIP 20250925 GTIA	25/09/2025	1,000	101.505,89
BANKIA, S.A.	ES0413307101	BKIA/1,125 CEDHIP 20220805 GTIA	05/08/2022	1,125	104.724,96
BANKIA, S.A.	ES0413307119	BKIA/0,875 CEDHIP 20210121 GTIA	21/01/2021	0,875	103.913,78
BANKIA, S.A.	ES0413307127	BKIA/1,00 CEDHIP 20230314 GTIA	14/03/2023	1,000	103.570,16
BANKIA, S.A.	ES0414950628	CA.MADRID/4,00 CEDHIP 20250203 GTIA	03/02/2025	4,000	124.650,14
BANKIA, S.A.	ES0414950644	CA.MADRID/4,125 CEDHIP 20360324	24/03/2036	4,125	65.259,20
BANKIA, S.A.	ES0414950651	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20180525 GTIA	25/05/2018	4,250	53.391,68
BANKIA, S.A.	ES0414950685	CA.MADRID/4,50 CEDHIP 20220426 GTIA	26/04/2022	4,500	61.181,65
BANKIA, S.A.	ES0414950693	CA.MADRID/5,00 CEDHIP 20190628 GTIA	28/06/2019	5,000	56.654,21
BANKINTER, S.A.	ES0413679178	BKT/4,125 CEDHIP 20170322 GTIA	22/03/2017	4,125	50.722,97
BANKINTER, S.A.	ES0413679277	BKT/3,125 CEDHIP 20180205 GTIA	05/02/2018	3,125	104.025,60
BANKINTER, S.A.	ES0413679327	BKT/1,00 CEDHIP 20250205 GTIA	05/02/2025	1,000	102.643,88
BANKINTER, S.A.	ES0413679343	BKT/0,875 CEDHIP 20220803 GTIA	03/08/2022	0,875	103.799,00
BANKINTER, S.A.	ES0413679350	BKT/0,625 CEDHIP 20201009 GTIA	09/10/2020	0,625	102.524,96
CAIXABANK, S.A.	ES0414970196	LACAIXA/4,75 CEDHIP 20181031 GTIA	31/10/2018	4,750	109.534,67
CAIXABANK, S.A.	ES0414970204	LACAIXA/3,875 CEDHIP 20250217 GTIA	17/02/2025	3,875	125.072,56
CAIXABANK, S.A.	ES0414970220	LACAIXA/VAR CEDHIP 20180109 GTIA	09/01/2018	V	100.069,39
CAIXABANK, S.A.	ES0414970246	LACAIXA/3,625 CEDHIP 20210118 GTIA	18/01/2021	3,625	57.584,75
CAIXABANK, S.A.	ES0414970295	LACAIXA/4,25 CEDHIP 20170126 GTIA	26/01/2017	4,250	50.390,67
CAIXABANK, S.A.	ES0414970303	LACAIXA/4,50 CEDHIP 20220126 GTIA	26/01/2022	4,500	61.411,28
CAIXABANK, S.A.	ES0414970352	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170330 GTIA	30/03/2017	V	998,83
CAIXABANK, S.A.	ES0414970394	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170930 GTIA	30/09/2017	V	998,50
CAIXABANK, S.A.	ES0414970402	LACAIXA/4,625 CEDHIP 20190604 GTIA	04/06/2019	4,625	56.386,33
CAIXABANK, S.A.	ES0440609040	CABK/4,00 CEDHIP 20170216 GTIA	16/02/2017	4,000	100.959,22
CAIXABANK, S.A.	ES0440609206	CABK/3,00 CEDHIP 20180322 GTIA	22/03/2018	3,000	104.502,10
CAIXABANK, S.A.	ES0440609248	CABK/2,625 CEDHIP 20240321 GTIA	21/03/2024	2,625	116.987,35
CAIXABANK, S.A.	ES0440609271	CABK/0,625 CEDHIP 20250327 GTIA	27/03/2025	0,625	97.771,88
CAIXABANK, S.A.	ES0440609305	CABK/0,625 CEDHIP 20201112 GTIA	12/11/2020	0,625	102.612,10
CAIXABANK, S.A.	ES0440609313	CABK/1,00 CEDHIP 20230208 GTIA	08/02/2023	1,000	105.097,62
CAIXABANK, S.A.	ES0440609321	CABK/VAR CEDHIP 20221222 GTIA	22/12/2022	V	100.001,00
CAJA RURAL DE CASTILLA-LA MANCHA, S. COOP. DE CREDITO	ES0457089003	CR.C.MANCHA/0,875 CEDHIP 20211001	01/10/2021	0,875	103.108,12
CAJA RURAL DE CASTILLA-LA MANCHA, S. COOP. DE CREDITO	ES0457089011	CR.C.MANCHA/0,875 CEDHIP 20240527 G	27/05/2024	0,875	104.350,97
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0415306002	CR.NAV/2,875 CEDHIP 20180611 GTIA	11/06/2018	2,875	104.565,48
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0415306036	CR.NAV/0,50 CEDHIP 20220316 GTIA	16/03/2022	0,500	102.579,91
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0415306051	CR.NAV/0,625 CEDHIP 20231201 GTIA	01/12/2023	0,625	99.682,68
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOP. DE CREDITO	ES0422714024	CRU/3,75 CEDHIP 20181122 GTIA	22/11/2018	3,750	107.291,68
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOP. DE CREDITO	ES0422714032	CRU/1,25 CEDHIP 20220126 GTIA	26/01/2022	1,250	103.765,74
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOP. DE CREDITO	ES0422714040	CRU/1,00 CEDHIP 20201022 GTIA	22/10/2020	1,000	103.016,90
DEUTSCHE BANK, S.A.E.	ES0413320054	DT.BK.SAE/0,625 CEDHIP 20201125	25/11/2020	0,625	103.076,67
DEUTSCHE BANK, S.A.E.	ES0413320062	DT.BK.SAE/1,125 CEDHIP 20230120	20/01/2023	1,125	104.676,43
DEUTSCHE BANK, S.A.E.	ES0413320088	DT.BK.SAE/0,625 CEDHIP 20211215	15/12/2021	0,625	99.687,59
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0444251047	IBERCAJA.BCO/0,25 CEDHIP 20230108 G	18/10/2023	0,250	99.507,68
KUTXABANK, S.A.	ES0443307014	KUTXABANK/3,00 CEDHIP 20170201 GTIA	01/02/2017	3,000	100.530,72
KUTXABANK, S.A.	ES0443307048	KUTXABANK/1,75 CEDHIP 20210527 GTIA	27/05/2021	1,750	106.905,34
KUTXABANK, S.A.	ES0443307063	KUTXABANK/1,25 CEDHIP 20250922 GTIA	22/09/2025	1,250	104.076,51

PAGARÉS

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862C00	SAB/PAG 20170118	18/01/2017	C	999,63
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862DG4	SAB/PAG 20170215	15/02/2017	C	998,19
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862DS9	SAB/PAG 20170308	08/03/2017	C	998,26
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862EC1	SAB/PAG 20170329	29/03/2017	C	1.000,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862EE7	SAB/PAG 20170405	05/04/2017	C	998,98
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862EF4	SAB/PAG 20170412	12/04/2017	C	997,95
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862EL2	SAB/PAG 20170426	26/04/2017	C	998,55
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862EZ2	SAB/PAG 20170517	17/05/2017	C	999,19
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862FM7	SAB/PAG 20170614	14/06/2017	C	998,18
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862GL7	SAB/PAG 20170906	06/09/2017	C	999,60
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862GV6	SAB/PAG 20170927	27/09/2017	C	999,51
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862GY0	SAB/PAG 20171004	04/10/2017	C	999,03
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862HD2	SAB/PAG 20171018	18/10/2017	C	999,04
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862HE0	SAB/PAG 20171025	25/10/2017	C	999,04
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806Z08	POP/PAG 20170517	17/05/2017	C	998,18
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513807240	POP/PAG 20171213	13/12/2017	C	996,68
CAIXABANK, S.A.	ES05406099N5	CABK/PAG 20170207	07/02/2017	C	999,30
CAIXABANK, S.A.	ES05406099O3	CABK/PAG 20170221	21/02/2017	C	999,15
CAIXABANK, S.A.	ES0540609A18	CABK/PAG 20170525	25/05/2017	C	998,34
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495OP1	SAN.CONS.FIN/PAG 20170214	14/02/2017	C	100.014,52
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495OY3	SAN.CONS.FIN/PAG 20170331	31/03/2017	C	99.973,84
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495OZ0	SAN.CONS.FIN/PAG 20170405	05/04/2017	C	100.000,00
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PD4	SAN.CONS.FIN/PAG 20170412	12/04/2017	C	99.971,53
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PX2	SAN.CONS.FIN/PAG 20170310	10/03/2017	C	100.012,00
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495QB6	SAN.CONS.FIN/PAG 20170105	05/01/2017	C	100.018,54
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495QE0	SAN.CONS.FIN/PAG 20170123	23/01/2017	C	100.018,28
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495QO9	SAN.CONS.FIN/PAG 20170320	20/03/2017	C	100.029,90
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495QV4	SAN.CONS.FIN/PAG 20170512	12/05/2017	C	99.959,24
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495QW2	SAN.CONS.FIN/PAG 20170522	22/05/2017	C	99.963,84
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495QX0	SAN.CONS.FIN/PAG 20170529	29/05/2017	C	99.962,49
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495QZ5	SAN.CONS.FIN/PAG 20170130	30/01/2017	C	100.027,87
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495RA6	SAN.CONS.FIN/PAG 20171204	04/12/2017	C	100.029,93
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495RJ7	SAN.CONS.FIN/PAG 20180705	05/07/2018	C	99.681,38
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495RW0	SAN.CONS.FIN/PAG 20171013	13/10/2017	C	100.039,14
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495RX8	SAN.CONS.FIN/PAG 20171023	23/10/2017	C	100.039,80
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495RY6	SAN.CONS.FIN/PAG 20181029	29/10/2018	C	99.713,92
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495RZ3	SAN.CONS.FIN/PAG 20171106	06/11/2017	C	100.059,38
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495SB2	SAN.CONS.FIN/PAG 20181128	28/11/2018	C	99.641,95
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495SC0	SAN.CONS.FIN/PAG 20180529	29/05/2018	C	99.940,30
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495SD8	SAN.CONS.FIN/PAG 20181212	12/12/2018	C	99.504,59
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495SE6	SAN.CONS.FIN/PAG 20180320	20/03/2018	C	99.950,79
TELEFONICA, S.A.	ES0578430MI9	TEF/PAG 20170615	15/06/2017	C	99.959,22
TELEFONICA, S.A.	ES0578430MU4	TEF/PAG 20170406	06/04/2017	C	99.999,60
TELEFONICA, S.A.	ES0578430MV2	TEF/PAG 20170914	14/09/2017	C	100.003,74

PARTICIPACIONES PREFERENTES

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
CAIXASABADELL PREFERENTS, S.A.U.	ES01011339028	CAIXASAB.PREF/IVAR NACU AMTB PPR B		V	37.359,30
PASTOR PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.U.	ES01688569004	PASTOR.PREF/IVAR NACU AMTB PPR 1	02/01/2017	V	100,83

RENTA VARIABLE

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Valor Medio en Euros
1NKEMIA IUCT GROUP, S.A.	ES0156303002	KM/AC 0,10	2,17
AB-BIOTICS, S.A.	ES0109669013	AB-BIOTICS/AC 0,05	1,60
ABENGOA, S.A.	ES0105200002	ABG/AC B 0,0002	0,20
ABENGOA, S.A.	ES0105200416	ABG/AC A 0,02	0,51
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0111845014	ABE/AC 3,00	13,18
ACCIONA, S.A.	ES0125220311	ANA/AC 1,00	67,09
ACERINOX, S.A.	ES0132105018	ACX/AC 0,25	11,91
ACS. ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS, S.A.	ES0167050915	ACS/AC 0,50	27,91
ADOLFO DOMINGUEZ, S.A.	ES0106000013	ADZ/AC 0,60	3,25
ADVEO GROUP INTERNATIONAL, S.A.	ES0182045312	ADV/AC 1,50	3,22
AENA, S.A.	ES0105046009	AENA/AC 10,00	129,10
AGILE CONTENT, S.A.	ES0105102000	AGILE CONTENT/AC 0,10	1,72
AIRBUS GROUP, S.E.	NL0000235190	AC, AIRBUS	57,14
ALANTRA PARTNERS, S.A.	ES0126501131	ALNT/AC 3,00	8,06
ALFA, S.A.B. DE C.V.	MXP000511016	AC, ALFA S/A	1,36
ALMIRALL, S.A.	ES0157097017	ALM/AC 0,12	13,84
ALTIA CONSULTORES, S.A.	ES0113312005	ALTIA CONSULT/AC 0,02	16,00
ALZA REAL ESTATE, S.A.	ES0138436011	ALZA/AC 1,00	1,35
AMADEUS IT GROUP, S.A.	ES0109067019	AMS/AC A 0,01	42,62
AMERICA MOVIL, S.A.B. DE C.V.	MXP001691213	AC, AMERICA MOVIL S/L	0,56
AMPER, S.A.	ES0109260531	AMPI/AC 0,05	0,14
APERAM SOCIETE ANONYME	LU0569974404	APAM/AC SVN	42,16
APPLUS SERVICES, S.A.	ES0105022000	APPS/AC 0,10	8,94
ARCELORMITTAL, S.A.	LU0323134006	ARCELORMITTAL/AC SVN	6,60
ATRESMEDIA CORPORACION DE MEDIOS DE COMUNICACION, S.A.	ES0109427734	A3M/AC A 0,75	9,74
ATRY'S HEALTH, S.A.	ES0105148003	ATRY'S/AC 0,01	1,46
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI, S.A.	ES0105026001	AXIA/AC 10,00	12,74
AZKOYEN, S.A.	ES0112458312	AZK/AC 0,60	5,41
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0113211835	BBVA/AC 0,49	6,07
BANCO BRADESCO, S.A.	BRBBDACNPR8	AC, BANCO BRADESCO -PREF.-	8,23
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0113860A34	SAB/AC 0,125	1,24
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0113790226	POPI/AC 0,50	0,98
BANCO SANTANDER RIO, S.A.	ARBRI0010194	AC, BCO SANTANDER RIO, S/B	1,93
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0113900J37	SAN/AC 0,50	4,43
BANKIA, S.A.	ES0113307021	BKIA/AC 0,80	0,85
BANKINTER, S.A.	ES0113679I37	BKI/AC 0,30	7,02
BARON DE LEY, S.A.	ES0114297015	BDL/AC 0,60	105,65
BAYER A.G.	DE000BAY0017	AC, BAYER	91,84
BBVA BANCO FRANCES, S.A.	ARF125991090	AC, BBVA BCO. FRANCES	5,41
BIOORGANIC RESEARCH AND SERVICES, S.A.	ES0184980003	BNT/AC 0,05	3,04
BIOSEARCH, S.A.	ES0172233118	BIO/AC 0,24	0,58
BODEGAS BILBAINAS, S.A.	ES0114930011	BODEGAS.BILB/AC 6,01	6,91
BODEGAS RIOJANAS, S.A.	ES0115002018	RIO/AC 0,75	4,14
BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOL, S.A. SDAD HOLDING DE MDOS Y STMAS FIN., S.A.	ES0115056139	BME/AC 3,00	28,01
BRADESPAR, S.A.	BRBRAPACNOR5	AC, BRADESPAR	3,49
BRADESPAR, S.A.	BRBRAPACNPR2	AC, BRADESPAR -PREF.-	4,13
BRASKEM, S.A.	BRBRKMACNPA4	AC, BRASKEM -PREF.-	8,34
CAIXABANK, S.A.	ES0140609019	CABK/AC 1,00	2,80
CARBURES EUROPE, S.A.	ES0116162068	CARBURES/AC 0,17	0,56
CARTERA INDUSTRIAL REA, S.A.	ES0162292017	CART.IND.REA/AC 2,30	1,05
CATENON, S.A.	ES0112320009	CATENON/AC 0,02	0,43
CELLNEX TELECOM, S.A.	ES0105066007	CLNX/AC 0,25	14,19
CEMENTOS MOLINS, S.A.	ES0117360117	CEMENTOS.MOLINS/AC 0,30	10,68
CEMENTOS PORTLAND VALDERRIVAS, S.A.	ES0117390411	CPL/AC 1,50	6,15
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNOR6	AC, ELETROBRAS	6,41
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNPR7	AC, ELETROBRAS. PREF. S/B	7,43
CIE AUTOMOTIVE, S.A.	ES0105630315	CIE/AC 0,25	17,83
CLERHP ESTRUCTURAS, S.A.	ES0105121000	CLERHP/AC 0,04	1,41
CLEVER GLOBAL, S.A.	ES0105152005	CLEVER/AC 0,01	0,86
CLINICA BAVIERA, S.A.	ES0119037010	CBAV/AC 0,10	8,53
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS, PLC	GB00BDCPN049	COCA EURO PART/AC 0,01	32,60
CODERE, S.A.	ES0119256115	CDR/AC 0,20	0,66
COMM CENTER, S.A.	ES0121071007	COMM CENTER/AC 0,50	1,51
COMPANHIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	BRCMIGACNPR3	AC, CEMIG -PREF.-	2,26
COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	BRCPLEACNPR8	AC, COPEL -PREF.-	8,19
COMPANHIA DE DISTRIBUCION INTEGRAL LOGISTA HOLDINGS, S.A.	ES0105027009	LOGI/AC 0,20	20,58
COMPANHIA ESPAÑOLA DE VIVIENDAS EN ALQUILER, S.A.	ES0132955008	CEVASA/AC 0,30	9,30
CONSTRUCCIONES Y AUXILIAR DE FERROCARRILES, S.A.	ES0121975009	CAF/AC 0,301	36,25
CORPFIN CAPITAL PRIME RETAIL III SOCIMI, S.A.	ES0105111001	CORPFIN CAP III/AC 1,00	1,53
CORPORACION EMPRESARIAL DE MATERIALES DE CONSTRUCCION, S.A.	ES0182170615	URA/AC 0,01	0,51
CORPORACION FINANCIERA ALBA, S.A.	ES0117160111	ALB/AC 1,00	40,03
CORPORACION GEO, S.A.B. DE C.V.	MXP3142C1177	AC, GEO. S/B	0,37
DEOLEO, S.A.	ES0110047919	OLE/AC 0,38	0,20
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION, S.A.	ES0126775032	DIA/AC 0,10	4,83
DOGI INTERNATIONAL FABRICS, S.A.	ES0126962002	DGI/AC 0,064	3,03
DURO FELGUERA, S.A.	ES0162600417	MDF/AC 0,50	1,12
EBOSS ENERGY, A.D.	BG1100025128	EBOSS ENERGY/AC 1,00	1,06
EBRO FOODS, S.A.	ES0112501012	EBRO/AC 0,60	19,84
ECOLUMBER, S.A.	ES0127232017	ECOLUMBER/AC 0,85	1,09
EDREAMS ODIGEO, S.A.	LU1048338220	EDREAMS/AC 0,10	2,86
ELECNOR, S.A.	ES0129743318	ENO/AC 0,10	8,90
ENAGAS, S.A.	ES0130960018	ENG/AC 1,50	24,62
ENCE ENERGIA Y CELULOSA, S.A.	ES0130625512	ENC/AC 0,90	2,09
ENDESA, S.A.	ES0130670112	ELE/AC 1,20	19,22
ENTRECAMPOS CUATRO SOCIMI, S.A.	ES0131172001	ENTRECAMPOS 4/AC 0,898	1,86
ERCROS, S.A.	ES0125140A14	ECR/AC 0,30	1,97
EUROCONSULT ENGINEERING CONSULTING GROUP, S.A.	ES0105042008	EUROCONSULT/AC 0,20	1,98
EUROESPES, S.A.	ES0133421000	EUROESPES/AC 0,601012	0,65
EURONA WIRELESS TELECOM, S.A.	ES0133443004	EURONA.WIRELESS/AC 1,00	2,46
EUSKALTEL, S.A.	ES0105075008	EUSKALTEL/AC 3,00	8,58
FACEPHI BIOMETRIA, S.A.	ES0105029005	FACE/AC 0,04	0,72
FAES FARMA, S.A.	ES0134950F36	FAE/AC 0,10	3,32

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Valor Medio en Euros
FERROVIAL, S.A.	ES0118900010	FER/AC 0,20	17,32
FERSA ENERGIAS RENOVABLES, S.A.	ES0136463017	FRS/AC 0,70	0,47
FIDERE PATRIMONIO SOCIMI, S.A.	ES0105071007	YFIDI/AC 1,00	19,20
FLUIDRA, S.A.	ES0137650018	FDR/AC 1,00	4,27
FOMENTO DE CONSTRUCCIONES Y CONTRATAS, S.A.	ES0122060314	FCC/AC 1,00	7,84
FUNESPAÑA, S.A.	ES0140441017	FUN/AC 0,30	6,53
GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA, S.A.	ES0143416115	GAM/AC 0,17	19,58
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0116870314	GAS/AC 1,00	17,18
GENERAL DE ALQUILER DE MAQUINARIA, S.A.	ES0141571119	GALQ/AC 0,10	0,26
GERDAU, S.A.	BRGGBRACNPR8	AC. GERDAU -PREF.-	3,35
GIGAS HOSTING, S.A.	ES0105093001	GIGAS HOSTING/AC 0,02	2,96
GLOBAL DOMINION ACCESS, S.A.	ES0105130001	DOM/AC 0,125	2,91
GREENERGY RENOVABLES, S.A.	ES0105079000	GRE/AC 0,15	1,50
GRIFOLS, S.A.	ES0171996087	GRF/AC A 0,25	18,29
GRIFOLS, S.A.	ES0171996095	GRF/ACSVT B	14,18
GRÑO ECOLOGIC, S.A.	ES0143328005	GRÑO.ECOLOGIC/AC 0,02	1,28
GRUPO CATALANA OCCIDENTE, S.A.	ES0116920333	GCO/AC 0,30	28,68
GRUPO ELEKTRA, S.A. DE C.V.	MX01EL000003	AC. GRUPO ELEKTRA	12,04
GRUPO EMPRESARIAL SAN JOSE, S.A.	ES0180918015	GSJ/AC 0,03	3,03
GRUPO EZENTIS, S.A.	ES0172708234	EZE/AC 0,30	0,52
GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	MXFP370711014	AC. BANORTE S/O	4,64
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS SOCIMI, S.A.	ES0105019006	HIS/AC 1,00	11,08
HOME MEAL REPLACEMENT, S.A.	ES0105049003	HOME MEAL/AC 0,13	2,33
IBERDROLA, S.A.	ES01444580Y14	IBE/AC 0,75	5,92
IBERPAPEL GESTION, S.A.	ES0147561015	IBG/AC 0,60	20,53
IMAGINARIUM, S.A.	ES0147791018	IMAGINARIUM/AC 0,03	0,42
INCLAM, S.A.	ES0105083002	INCLAM/AC 0,01	2,00
INDRA SISTEMAS, S.A.	ES0118594417	IDR/AC A 0,20	10,66
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL, S.A.	ES0148396007	ITX/AC 0,03	32,02
INMOBILIARIA COLONIAL, S.A.	ES0139140174	COL/AC 2,50	6,36
INMOBILIARIA DEL SUR, S.A.	ES0154653911	ISUR/AC 2,00	8,29
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP, S.A.	ES0177542018	IAG/AC 0,50	4,91
INYPSA INFORMES Y PROYECTOS, S.A.	ES0152768612	INY/AC 0,137	0,18
LABORATORIO REIG JOFRE, S.A.	ES0165359029	RJF/AC 0,50	3,25
LABORATORIOS FARMACEUTICOS ROVI, S.A.	ES0157261019	ROVI/AC 0,06	12,34
LAR ESPAÑA REAL ESTATE SOCIMI, S.A.	ES0105015012	LRE/AC 2,00	6,68
LIBERBANK, S.A.	ES0168675090	LBK/AC 0,90	0,90
LIBERTAS 7, S.A.	ES0137998A12	LIBERTAS.7/AC 0,50	2,20
LINGOTES ESPECIALES, S.A.	ES0158480311	LGT/AC 1,00	14,56
LIWE ESPAÑOLA, S.A.	ES0158545030	LIWE.ESPAÑOLA/AC 3,15	11,90
LLEIDANETWORKS SERVEIS TELEMATICS, S.A.	ES0105089009	LLEIDANETWORKS/AC 0,02	0,64
MAPFRE, S.A.	ES0124244E34	MAP/AC 0,10	2,76
MASMOVIL IBERCOM, S.A.	ES0184696013	MAS/AC 0,10	25,93
MEDCOM TECH, S.A.	ES0161857018	MEDCOM.TECH/AC 0,01	5,04
MEDIASET ESPAÑA COMUNICACION, S.A.	ES0152503035	TL5/AC 0,50	10,23
MELIA HOTELS INTERNATIONAL, S.A.	ES0176252718	MEL/AC 0,20	10,88
MERLIN PROPERTIES SOCIMI, S.A.	ES0105025003	MRL/AC 1,00	9,86
MIQUEL Y COSTAS & MIQUEL, S.A.	ES0184180012	MCM/AC 2,00	27,87
MONDO TV IBEROAMÉRICA, S.A.	ES0105216008	MONDO TV IBAM/AC 0,05	1,43
MONTEBALITO, S.A.	ES0116494016	MTB/AC 1,00	1,51
NATRA, S.A.	ES0165515117	NAT/AC 0,1332	0,66
NATURHOUSE HEALTH, S.A.	ES0105043006	NTH/AC 0,05	4,76
NBI BEARINGS EUROPE, S.A.	ES0105062022	NBI BEARINGS/AC 0,10	1,53
NEOL BIOSOLUTIONS, S.A.	ES0105081006	NEOL/AC 0,48	1,15
NEURON BIO, S.A.	ES0166198012	NEU/AC 1,00	1,09
NH HOTEL GROUP, S.A.	ES0161560018	NHH/AC 2,00	3,90
NICOLAS CORREA, S.A.	ES0166300212	NEA/AC 0,80	1,49
OBRASCON HUARTE LAIN, S.A.	ES0142090317	OHL/AC 0,60	3,25
OBSIDO SOCIMI, S.A.	ES0105074001	OBSIDO/AC 5,00	5,06
ONLY-APARTMENTS, S.A.	ES0105038006	ONL/AC 0,10	2,35
OPTIMUM RE SPAIN, SOCIMI, S.A.	ES0105174009	OPTIMUM RE/AC 10,00	11,41
ORYZON GENOMICS, S.A.	ES0167733015	ORYZON GENOMICS/AC 0,05	3,77
PANGAEA ONCOLOGY, S.A.	ES0105221008	PANGAEA ONCO/AC 0,02	2,91
PAPELES Y CARTONES DE EUROPA, S.A.	ES0168561019	PAC/AC 2,00	4,77
PARQUES REUNIDOS SERVICIOS CENTRALES, S.A.	ES0105131009	PQR/AC 0,50	13,26
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNOR9	AC. PETROBRAS	4,96
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNPR6	AC. PETROBRAS -PREF.-	4,42
PHARMA MAR, S.A.	ES0169501030	PHARMA MAR/AC 0,05	2,57
PRIM, S.A.	ES0170884417	PRM/AC 0,25	8,45
PROMOTORA DE INFORMACIONES, S.A.	ES0171743901	PRS/AC 3,00	5,76
PROSEGUR. CIA. DE SEGURIDAD, S.A.	ES0175438003	PSG/AC 0,06	6,11
QUABIT INMOBILIARIA, S.A.	ES0110944172	QBT/AC 0,50	1,93
QUONIA SOCIMI, S.A.	ES0105150009	QUONIA/AC 1,00	1,66
REALIA BUSINESS, S.A.	ES0173008015	RLIA/AC 0,24	0,87
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0173093024	REE/AC 0,50	17,82
RENO DE MEDICI, S.P.A.	IT0001178299	AC. RENO DE MEDICI. S/A	0,29
RENTA 4 BANCO, S.A.	ES0173358039	R4/AC 0,45	5,80
RENTA CORPORACION REAL ESTATE, S.A.	ES0173365018	REN/AC 1,00	1,93
REPSOL, S.A.	ES0173516115	REP/AC 1,00	12,75
RONSA, S.A.	ES0174300014	RONSA/AC 60,10	50,00
SACYR, S.A.	ES0182870214	SYV/AC 1,00	2,07
SAETA YIELD, S.A.	ES0105058004	SAY/AC 1,00	8,43
SARE, S.A.B., DE C.V.	MX01SA030007	AC. SARE. S/B	0,01
SECUOYA GRUPO DE COMUNICACION, S.A.	ES0131703003	SECUOYA.COM/AC 0,0125	9,60
SERVICE POINT SOLUTIONS, S.A.	ES0143421073	SPS/AC 0,01	1,77
SNIACE, S.A.	ES0165380017	SNC/AC 0,10	0,30
SOLARIA ENERGIA Y MEDIO AMBIENTE, S.A.	ES0165386014	SLR/AC 0,01	0,77
SOTOGRADE, S.A.	ES0138109014	STG/AC 0,60	2,94
TALGO, S.A.	ES0105065009	TLGO/AC 0,301	4,36
TECNICAS REUNIDAS, S.A.	ES0178165017	TRE/AC 0,10	35,28
TECNOCOM, TELECOMUNICACIONES Y ENERGIA, S.A.	ES0147582B12	TEC/AC 0,50	3,57
TECNOQUARK TRUST, S.A.	ES0105076006	TECNOQUARK/AC 1,00	1,89

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Valor Medio en Euros
TELEFONICA, S.A.	ES0178430E18	TEF/AC 1,00	8,59
TELEPIZZA GROUP, S.A.	ES0105128005	TPZ/AC 0,25	4,44
THINK SMART, S.A.	ES0105097002	THK/AC 0,10	2,89
TRAJANO IBERIA SOCIMI, S.A.	ES0105077004	TRAJANO IBERIA/AC 2,50	10,41
TUBACEX, S.A.	ES0132945017	TUB/AC 0,45	2,72
TUBOS REUNIDOS, S.A.	ES0180850416	TRG/AC 0,10	0,87
TV AZTECA, S.A. DE C.V.	MX01A2060013	AC. TV AZTECA	0,16
UNION EUROPEA DE INVERSIONES, S.A.	ES0181480114	U.EUROPEA INV/AC 1,00	0,12
URBAR INGENIEROS, S.A.	ES0182484214	URBAR.ING/AC 0,17	0,26
URBAS GRUPO FINANCIERO, S.A.	ES0182280018	URBAS/AC 0,01	0,01
URO PROPERTY HOLDINGS SOCIMI, S.A.	ES0105059002	YURO/AC 2,00	43,08
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNOR3	AC. USIMINAS	2,40
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNPA6	AC. USIMINAS -PREF.-	1,14
VALE, S.A.	BRVALEACNOR0	AC. VALE	6,89
VALE, S.A.	BRVALEACNPA3	AC. VALE. PREF. 6%	6,20
VIDRALA, S.A.	ES0183746314	VID/AC 1,02	50,31
VISCOFAN, S.A.	ES0184262212	VIS/AC 0,70	45,57
VOCENTO, S.A.	ES0114820113	VOC/AC 0,20	1,20
VOLCAN COMPAÑIA MINERA, S.A.A.	PEP648014202	AC. VOLCAN. PREF. S/B	0,18
VOUSSE CORP, S.A.	ES0176406066	VOUSSE/AC 1,50	0,60
VOZTELECOM OIGAA360, S.A.	ES0105156006	VOZTELECOM/AC 0,10	2,63
ZAMBAL SPAIN SOCIMI, S.A.	ES0105080008	ZAMBAL SPAIN/AC 1,00	1,24
ZARDOYA OTIS, S.A.	ES0184933812	ZOT/AC 0,10	7,76
ZINKIA ENTERTAINMENT, S.A.	ES0184849018	ZNK/AC 0,10	0,74

(*) ANCV: Agencia Nacional de Codificación de Valores

(**) V: Cupón Variable, C: Cupón Cero