

III. OTRAS DISPOSICIONES

MINISTERIO DE HACIENDA Y ADMINISTRACIONES PÚBLICAS

- 1899** *Orden HAP/214/2016, de 18 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 2015, a efectos de la declaración del Impuesto sobre el Patrimonio del año 2015 y de la declaración informativa anual acerca de valores, seguros y rentas.*

La Ley 36/2014, de 26 de diciembre, de Presupuestos Generales del Estado para el año 2015, 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 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 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 Administraciones Públicas, de acuerdo con lo dispuesto en el artículo 5 y en la disposición final segunda del Real Decreto 1823/2011, de 21 de diciembre, 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 2015; 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 2015, anexas a esta Orden, a efectos de la declaración del Impuesto sobre el Patrimonio del ejercicio 2015 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, 18 de febrero de 2016.—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 2015, a los efectos previstos 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, y a efectos de la declaración del Impuesto sobre el Patrimonio del ejercicio 2015

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	Cupón	Valor Medio
			Vencimiento	(**)	Porcentaje
COMUNIDAD AUTONOMA DE CASTILLA Y LEON	ES0001351180	CC.AA.C-LE/4,65 OB SEGR 20221108	08/11/2022	4,650	120,050
COMUNIDAD AUTONOMA DE CASTILLA Y LEON	ES0001351339	CC.AA.C-LE/6,27 OBSEGR 20180219	19/02/2018	6,270	113,300
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101263	CC.AA.MAD/4,30 OB 20260915	15/09/2026	4,300	120,456
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101313	CC.AA.MAD/4,99 OB 20180617	17/06/2018	4,990	111,553
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101396	CC.AA.MAD/4,688 OB 20200312	12/03/2020	4,688	116,014
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101446	CC.AA.MAD/6,213 BO 20160621	21/06/2016	6,213	103,700
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101545	CC.AA.MAD/5,75 BO 20180201	01/02/2018	5,750	111,908
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101586	CC.AA.MAD/2,875 OB 20190406	06/04/2019	2,875	108,074
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101602	CC.AA.MAD/4,125 OB 20240521	21/05/2024	4,125	117,470
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101644	CC.AA.MAD/2,875 OB 20230717	17/07/2023	2,875	108,985
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101651	CC.AA.MAD/1,826 OB 20250430	30/04/2025	1,826	97,355
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101677	CC.AA.MAD/2,08 OB 20300312	12/03/2030	2,080	91,500
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101693	CC.AA.MAD/1,189 OB 20220508	08/05/2022	1,189	98,750
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011868	ESTADO/6,00 OBE SEGR 20290131	31/01/2029	6,000	146,163
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011876	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20290131	31/01/2029	C	73,322
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011900	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20160131	31/01/2016	C	99,998
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011918	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170131	31/01/2017	C	99,935
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011926	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20180131	31/01/2018	C	99,667
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011934	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20190131	31/01/2019	C	98,273
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011967	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20220131	31/01/2022	C	93,175
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011975	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20230131	31/01/2023	C	91,307
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000011983	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20240131	31/01/2024	C	87,745
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012007	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20260131	31/01/2026	C	82,789
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012023	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20270131	31/01/2027	C	79,097
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012031	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20280131	31/01/2028	C	76,319
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012049	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20290131	31/01/2029	C	72,345
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000120D1	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20370131	31/01/2037	C	54,997
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000120G4	ESTADO/3,15 OBE SEGR 20160131	31/01/2016	3,150	100,638
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000120I0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20160131	31/01/2016	C	100,012
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000120J8	ESTADO/3,80 OBE SEGR 20170131	31/01/2017	3,800	104,192
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000120M2	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20170131	31/01/2017	C	99,976
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000120N0	ESTADO/4,90 OBE SEGR 20400730	30/07/2040	4,900	138,938
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000120O8	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20400730	30/07/2040	C	49,092
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000120P5	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20330730	30/07/2033	C	60,283
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121A5	ESTADO/4,10 OBE SEGR 20180730	30/07/2018	4,100	110,111
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121F4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20180730	30/07/2018	C	99,204
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121G2	ESTADO/4,80 OBESEGR 20240131	31/01/2024	4,800	126,050
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121K4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20240131	31/01/2024	C	88,523
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121L2	ESTADO/4,60 OBESEGR 20190730	30/07/2019	4,600	115,095
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121O6	ESTADO/4,30 OBESEGR 20191031	31/10/2019	4,300	115,057
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121R9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20190730	30/07/2019	C	98,707
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121S7	ESTADO/4,70 OBESEGR 20410730	30/07/2041	4,700	132,117
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000121V1	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20191031	31/10/2019	C	98,253
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122C9	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20191031	31/10/2019	C	97,580
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122D7	ESTADO/4,00 OBESEGR 20200430	30/04/2020	4,000	114,529
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122E5	ESTADO/4,65 OBESEGR 20250730	30/07/2025	4,650	126,357
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122I6	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20200430	30/04/2020	C	97,219
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122N6	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170430	30/04/2017	C	99,770
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122Q9	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20200430	30/04/2020	C	95,679
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122T3	ESTADO/4,85 OBESEGR 20201031	31/10/2020	4,850	119,851
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122V9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20410730	30/07/2041	C	45,495
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122X5	ESTADO/3,25 BOESTSEGR 20160430	30/04/2016	3,250	101,299
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000122Z0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20201031	31/10/2020	C	96,108
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123B9	ESTADO/5,50 OBESEGR 20210430	30/04/2021	5,500	124,822
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123C7	ESTADO/5,90 OBESEGR 20260730	30/07/2026	5,900	138,231
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123E3	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20160430	30/04/2016	C	100,002
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123F0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20210430	30/04/2021	C	95,525
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123G8	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20210430	30/04/2021	C	94,638
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123I4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20260730	30/07/2026	C	80,850
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123J2	ESTADO/4,25 BOESTSEGR 20161031	31/10/2016	4,250	104,123
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123K0	ESTADO/5,85 OBESEGR 20220131	31/01/2022	5,850	129,468
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123N4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20220131	31/01/2022	C	94,088
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123Q7	ESTADO/4,50 BOESTSEGR 20180131	31/01/2018	4,500	109,753
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123U9	ESTADO/5,40 OBESEGR 20230131 CAC	31/01/2023	5,400	128,152
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123W5	ESTADO/3,30 BOESTSEGR 20160730 CAC	30/07/2016	3,300	102,135
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000123X3	ESTADO/4,40 OBESEGR 20231031 CAC	31/10/2023	4,400	122,243
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012411	ESTADO/5,75 OBESEGR 20320730	30/07/2032	5,750	147,168

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124B7	ESTADO/3,75 BOESTSEGR 20181031 CAC	31/10/2018	3,750	110,426
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124C5	ESTADO/5,15 OBESEGR 20281031 CAC	31/10/2028	5,150	134,140
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124H4	ESTADO/5,15 OBESEGR 20441031 CAC	31/10/2044	5,150	144,223
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124I2	ESTADO/2,10 BOESTSEGR 20170430 CAC	30/04/2017	2,100	102,985
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124J0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20181031 CAC	31/10/2018	C	99,066
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124V5	ESTADO/2,75 BOESTSEGR 20190430 CAC	30/04/2019	2,750	108,138
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000124W3	ESTADO/3,80 OBESEGR 20240430 CAC	30/04/2024	3,800	116,565
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012593	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20320730	30/07/2032	C	65,627
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000125H1	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20281031 CAC	31/10/2028	C	75,036
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000125I9	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20241031 CAC	31/10/2024	C	85,701
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000125J7	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20251031 CAC	31/10/2025	C	83,359
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012619	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20160730	30/07/2016	C	99,959
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012627	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170730	30/07/2017	C	99,779
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012635	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20180730	30/07/2018	C	99,183
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012643	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20190730	30/07/2019	C	98,016
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012650	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20200730	30/07/2020	C	96,207
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012668	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20210730	30/07/2021	C	93,322
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012692	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20240730	30/07/2024	C	86,750
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126A4	ESTADO/VAR OBESEGR 20241130 CAC	30/11/2024	V	110,071
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126B2	ESTADO/2,75 OBESEGR 20241031 CAC	31/10/2024	2,750	108,862
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126C0	ESTADO/1,40 BOESTSEGR 20200131 CAC	31/01/2020	1,400	103,561
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126D8	ESTADO/4,00 OBESEGR 20641031 CAC	31/10/2064	4,000	125,000
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126E6	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20441031 CAC	31/10/2044	C	43,107
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126G1	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20301031 CAC	31/10/2030	C	70,598
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126T4	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20431031 CAC	31/10/2043	C	44,575
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126U2	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20441031 CAC	31/10/2044	C	43,308
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126V0	ESTADO/0,50 BOESTSEGR 20171031 CAC	31/10/2017	0,500	100,873
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126W8	ESTADO/VAR BOESTSEGR 20191130 CAC	30/11/2019	V	102,865
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000126Z1	ESTADO/1,60 OBESEGR 20250430 CAC	30/04/2025	1,600	99,641
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012775	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20320730	30/07/2032	C	63,055
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012783	ESTADO/5,50 OBE SEGR 20170730	30/07/2017	5,500	109,541
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000127A2	ESTADO/1,95 OBESEGR 20300730 CAC	30/07/2030	1,950	96,088
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000127C8	ESTADO/VAR OBESEGR 20301130 CAC	30/11/2030	V	99,226
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000127D6	ESTADO/0,25 BOESTSEGR 20180430 CAC	30/04/2018	0,250	100,168
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000127G9	ESTADO/2,15 OBESEGR 20251031 CAC	31/10/2025	2,150	103,031
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES00000127H7	ESTADO/1,15 BOESTSEGR 20200730 CAC	30/07/2020	1,150	101,702
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012817	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20170730	30/07/2017	C	99,932
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012932	ESTADO/4,20 OBE SEGR 20370131	31/01/2037	4,200	124,109
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012957	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20310131	31/01/2031	C	67,197
FONDO DE REESTRUCTURACION ORDENADA BANCARIA	ES0302761020	FROB/5,50 BO 20160712 GTIA	12/07/2016	5,500	102,924
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950E9	GENCAT/4,95 OB 20200211	11/02/2020	4,950	116,905
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000958I2	GENCAT/VAR OB 20180613	13/06/2018	V	99,992
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095879	GENCAT/4,22 OB 20350426	26/04/2035	4,220	95,000
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095895	GENCAT/4,30 OB 20161115	15/11/2016	4,300	101,198
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095929	GENCAT/4,75 OB 20180604	04/06/2018	4,750	102,160
GOBIERNO VASCO	ES0000106437	GOB.VASCO/4,15 OB 20191028	28/10/2019	4,150	112,136
GOBIERNO VASCO	ES0000106494	GOB.VASCO/3,99 OB 20160128	28/01/2016	3,990	103,927
GOBIERNO VASCO	ES0000106510	GOB.VASCO/6,375 OB 20210420	20/04/2021	6,375	131,105
GOBIERNO VASCO	ES0000106528	GOB.VASCO/4,90 OB 20200326	26/03/2020	4,900	118,953
GOBIERNO VASCO	ES0000106536	GOB.VASCO/2,00 BO 20180723	23/07/2018	2,000	108,600
GOBIERNO VASCO	ES0000106544	GOB.VASCO/1,25 BO 20230413	13/04/2023	1,250	96,700
JUNTA DE ANDALUCIA	ES0000090714	JUNTA.AND/4,85 OBESEGR 20200317	17/03/2020	4,850	115,750
XUNTA DE GALICIA	ES0001352519	XUNTA/2,75 BO 20170202	02/02/2017	2,750	102,977

**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	ES0555281353	ICF/PAG 20160630	30/06/2016	C	99,495
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0555281387	ICF/PAG 20161031	31/10/2016	C	99,146
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0555281395	ICF/PAG 20161230	30/12/2016	C	99,008
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0555281411	ICF/PAG 20170105	05/01/2017	C	98,438
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0555281437	ICF/PAG 20170331	31/03/2017	C	98,520
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0555281460	ICF/PAG 20170630	30/06/2017	C	98,182
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0555281478	ICF/PAG 20170831	31/08/2017	C	97,821

LETRAS DEL TESORO

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01601225	ESTADO/LT 20160122	22/01/2016	C	100,023
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01602199	ESTADO/LT 20160219	19/02/2016	C	100,032
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01603114	ESTADO/LT 20160311	11/03/2016	C	100,038
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01604088	ESTADO/LT 20160408	08/04/2016	C	100,028
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01605135	ESTADO/LT 20160513	13/05/2016	C	100,018
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01606174	ESTADO/LT 20160617	17/06/2016	C	99,981
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01607156	ESTADO/LT 20160715	15/07/2016	C	99,994
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01608196	ESTADO/LT 20160819	19/08/2016	C	99,991
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01609160	ESTADO/LT 20160916	16/09/2016	C	99,995
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01610143	ESTADO/LT 20161014	14/10/2016	C	99,990
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01611182	ESTADO/LT 20161118	18/11/2016	C	100,040
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0L01612099	ESTADO/LT 20161209	09/12/2016	C	100,008

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	114.556,36
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845211	ABE/5,125 OB 20170612	12/06/2017	5,125	53.673,41
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845237	ABE/4,625 OB 20161014	14/10/2016	4,625	51.936,82
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845252	ABE/4,75 OB 20191025	25/10/2019	4,750	115.221,90
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845260	ABE/3,75 OB 20230620	20/06/2023	3,750	114.819,95
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845294	ABE/2,50 OB 20250227	27/02/2025	2,500	105.080,91
ADIF-ALTA VELOCIDAD	ES0200002006	ADIF AV/1,875 OB 20250128	28/01/2025	1,875	99.094,08
ADIF-ALTA VELOCIDAD	ES0200002014	ADIF AV/1,875 OB 20220922	22/09/2022	1,875	101.392,18
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR-LEONESA, S.A.	ES0211843091	AUCALSA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	504,39
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839156	AUDASA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	505,12
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839164	AUDASA/4,85 OB 20180327 GTIA	27/03/2018	4,850	529,30
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839172	AUDASA/6,00 OB 20210531 GTIA	31/05/2021	6,000	571,52
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839180	AUDASA/5,75 OB 20220516 GTIA	16/05/2022	5,750	675,14
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839198	AUDASA/5,20 OB 20230626 GTIA	26/06/2023	5,200	554,23
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839206	AUDASA/4,75 OB 20200401 GTIA	01/04/2020	4,750	534,05
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839214	AUDASA/3,75 OB 20251214 GTIA	14/12/2025	3,750	519,21
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211107	BBVA/VAR OB SUBD 20220216	16/02/2022	V	50.553,44
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214973051	CA.SABADELL/VAR OB SUBD 20200128	28/01/2020	V	97.593,05
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214973069	CA.SABADELL/VAR OB SUBD 20170215	15/02/2017	V	49.424,52
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214973077	CA.SABADELL/VAR OBSUBD 20240610	10/06/2024	V	1.030,03
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214974067	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20210809	09/08/2021	V	93.785,71
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0214974075	CA.TERRASSA/VAR OBSUBD PERP	V	V	37.889,42
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213580030	GUI/VAR OB SUBD 20160321	21/03/2016	V	99.231,72
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860036	SAB/VAR OB SUBD 20160525	25/05/2016	V	99.714,04
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860051	SAB/6,25 OBSUBD 20200426	26/04/2020	6,250	56.159,74
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790001	POP/VAR OBSUBD 20191222	22/12/2019	V	49.901,24
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790019	POP/8,00 OBSUBD 20210729	29/07/2021	8,000	1.028,51
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790027	POP/8,25 OBSUBD 20211019	19/10/2021	8,250	1.048,40
BANKIA, S.A.	ES0213307004	BKIA/VAR OBSUBD 20240522	22/05/2024	V	99.565,16
BANKIA, S.A.	ES0214977094	BANCAJA/VAR OB 20160125	25/01/2016	V	99.926,13
BANKIA, S.A.	ES0214977144	BANCAJA/4,375 OB 20170214	14/02/2017	4,375	104.483,15
BANKINTER, S.A.	ES0213679154	BKT/VAR OB 20160616	16/06/2016	V	99.912,86
BANKINTER, S.A.	ES0213679162	BKT/VAR OB SUBD 20161219	19/12/2016	V	96.750,00
BANKINTER, S.A.	ES0213679196	BKT/6,375 OBSUBD 20190911	11/09/2019	6,375	56.811,29
BANKINTER, S.A.	ES02136791L5	BKT/VAR OBESTR 20190603 68	03/06/2019	V	2.499,89
BANKINTER, S.A.	ES02136791U6	BKT/VAR OBESTR 20190522 76	22/05/2019	V	75.430,66
BANKINTER, S.A.	ES02136792M1	BKT/VAR OBESTR 20190711 107	11/07/2019	V	17.712,52
BANKINTER, S.A.	ES02136793S6	BKT/VAR OBESTR 20190905 150	05/09/2019	V	7.343,78
BANKINTER, S.A.	ES02136796A7	BKT/VAR OBESTR 20200106 230	06/01/2020	V	47.935,12
BANKINTER, S.A.	ES02136796X9	BKT/VAR OBESTR 20200217 21	17/02/2020	V	48.978,93
BANKINTER, S.A.	ES02136797R9	BKT/VAR OBESTR 20200403 44	03/04/2020	V	48.709,99
BANKINTER, S.A.	ES02136799G8	BKT/VAR OBESTR 20200610 92	10/06/2020	V	48.042,42
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0205067012	BBVA GMI/4,00 OB 20351218 19	18/12/2035	4,000	100.000,00
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0205067020	BBVA GMI/4,00 OB 20351218 18	18/12/2035	4,000	100.000,00
CAIXABANK, S.A.	ES0213249008	CA.GIRONA/VAR OB SUBD 20160921	21/09/2016	V	99.209,81
CAIXABANK, S.A.	ES0214965008	CAN/VAR OB SUBD 20160616	16/06/2016	V	99.380,00
CAIXABANK, S.A.	ES0240609000	CABK/4,00 OBSUBD 20220209 I	09/02/2022	4,000	104,20
CAIXABANK, S.A.	ES0240609018	CABK/5,00 OBSUBD 20220209 II	09/02/2022	5,000	105,64
CANAL DE ISABEL II GESTION, S.A.	ES0205061007	CN ISABEL II/1,68 OB 20250226	26/02/2025	1,680	96.010,26
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICAS DE PRODUCTOS PETROLIFEROS	ES0224261018	CORES/4,50 OB 20180423	23/04/2018	4,500	110.114,33
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICAS DE PRODUCTOS PETROLIFEROS	ES0224261026	CORES/3,25 OB 20160419	19/04/2016	3,250	101.144,08
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICAS DE PRODUCTOS PETROLIFEROS	ES0224261034	CORES/2,50 OB 20241016	16/10/2024	2,500	104.031,97
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICAS DE PRODUCTOS PETROLIFEROS	ES0224261042	CORES/1,50 OB 20221127	27/11/2022	1,500	99.343,05
CRITERIA CAIXAHOLDING, S.A.U.	ES0205045000	CRITERIA/1,625 OB 20220421	21/04/2022	1,625	95.634,64
CRITERIA CAIXAHOLDING, S.A.U.	ES0214970081	LACAIXA/7,50 OBSUBD 20170131	31/01/2017	7,500	1.079,14
EROSKI, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429004	EROSKI/VAR OB SUBD PERP	V	V	10,54
EROSKI, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429038	EROSKI/VAR OB SUBD PERP	V	V	10,26
FERROVIAL EMISIONES, S.A.	ES0205032008	FER EMI/2,50 OB 20240715	15/07/2024	2,500	103.453,18
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0214954135	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20180420	20/04/2018	V	477,92
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0214954150	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20190425	25/04/2019	V	471,13
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0244251007	IBERCAJA.BCO/VAR OBSUBD 20250728	28/07/2025	V	96.374,94
LIBERBANK, S.A.	ES0268675008	LIBERBK/5,00 OBSUBDCONV 20180717 A	17/07/2018	5,000	3,27
LIBERBANK, S.A.	ES0268675016	LIBERBK/5,00 OBSUBDCONV 20180717 B	17/07/2018	5,000	3,23
LIBERBANK, S.A.	ES0268675024	LIBERBK/7,00 OBSUBDCONV 20180717 C	17/07/2018	7,000	10,16
MAPFRE, S.A.	ES0224244063	MAP/VAR OB SUBD 20370724	24/07/2037	V	51.602,93
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0213495007	SAN.CONS.FIN/VAR OB SUBD 20160928	28/09/2016	V	49.958,44

BONOS

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION THIRTEEN, F.T.	ES0305106009	A-BEST 13/VAR BTA 20300823 A GTIA	23/08/2030	V	100.000,00
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION THIRTEEN, F.T.	ES0305106017	A-BEST 13/VAR BTA 20300823 B GTIA	23/08/2030	V	100.000,00
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION THIRTEEN, F.T.	ES0305106025	A-BEST 13/2,30 BTA 20300823 M GTIA	23/08/2030	2,300	100.000,00
AUTO ABS 2012-3, F.T.A.	ES0311293007	ABS.2012-3/0,60 BTA 20240927 A GTIA	27/09/2024	0,600	59.929,99
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR-LEONESA, S.A.	ES0311843009	AUCALSA/4,35 BO 20190609	09/06/2019	4,350	525,82
AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, F.T.A.	ES0312272000	AYT.CAMUR.H.II/VAR BTA 20390407 A	07/04/2039	V	27.859,38
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298013	AYT.CCG/3,50 BTA 20160314 II GTIA	14/03/2016	3,500	101.114,50
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298021	AYT.CCG/3,75 BTA 20221214 III GTIA	14/12/2022	3,750	117.355,58
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298039	AYT.CCG/4,00 BTA 20180222 IV GTIA	22/02/2018	V	98.862,27
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298054	AYT.CCG/4,00 BTA 20210324 VI GTIA	24/03/2021	4,000	116.630,89
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298070	AYT.CCG/4,25 BTA 20180614 VIII GTIA	14/06/2018	4,250	110.059,77
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298096	AYT.CCG/4,25 BTA 20231025 X GTIA	25/10/2023	4,250	122.023,85
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298104	AYT.CCG/4,00 BTA 20161220 XI GTIA	20/12/2016	4,000	104.217,50
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298112	AYT.CCG/4,00 BTA 20170321 XII GTIA	21/03/2017	4,000	104.851,64
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298120	AYT.CCG/4,75 BTA 20270525 XIII GTIA	25/05/2027	4,750	129.159,41
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298153	AYT.CCG/VAR BTA 20171023 XVI GTIA	23/10/2017	V	99.320,01
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298229	AYT.CCG/4,75 BTA 20160615 XXIII	15/06/2016	4,750	102.679,84
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298245	AYT.CCG/4,50 BTA 20191202 XXV GTIA	02/12/2019	4,500	115.701,64
AYT CEDULAS CAJAS IX, F.T.A.	ES0312358015	AYT.CED.CA.IX/4,00 BTA 20200331 B	31/03/2020	4,000	114.036,53
AYT CEDULAS CAJAS V, F.T.A.	ES0370148019	AYT.CED.CA.V/4,75 BTA 20181204 B	04/12/2018	4,750	113.548,09
AYT CEDULAS CAJAS VIII, F.T.A.	ES0312362017	AYT.CED.CA.VIII/4,25 BTA 20191118 B	18/11/2019	4,250	115.187,11
AYT CEDULAS CAJAS X, F.T.A.	ES0312342019	AYT.CED.CA.X/3,75 BTA 20250630 B	30/06/2025	3,750	118.811,85
AYT DEUDA SUBORDINADA I, F.T.A.	ES0312284005	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 A	17/11/2016	V	62.511,99
AYT DEUDA SUBORDINADA I, F.T.A.	ES0312284013	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 B	17/11/2016	V	82.999,99
AYT GENOVA HIPOTECARIO II, F.T.H.	ES0370139000	AYT.GEN.H.II/VAR BTH 20341215 A	15/12/2034	V	18.049,80
AYT GENOVA HIPOTECARIO III, F.T.H.	ES0370143002	AYT.GEN.H.III/VAR BTH 20350715 A	15/07/2035	V	20.911,36
AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, F.T.H.	ES0370150007	AYT.GEN.H.IV/VAR BTH 20360516 A	16/05/2036	V	23.619,61
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, F.T.H.	ES0312300017	AYT.GEN.H.IX/VAR BTH 20390715 A2	15/07/2039	V	26.897,60
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, F.T.H.	ES0312343025	AYT.GEN.H.VII/VAR BTH 20380915 B	15/09/2038	V	30.000,60
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, F.T.H.	ES0312344023	AYT.GEN.H.VIII/VAR BTH 20390515 B	15/05/2039	V	29.520,79
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, F.T.H.	ES0312344031	AYT.GEN.H.VIII/VAR BTH 20390515 C	15/05/2039	V	29.374,57
AYT HIPOTECARIO III, F.T.H.	ES0312369004	AYT.HIP.III/VAR BTH 20330318 A GTIA	18/03/2033	V	11.268,15
AYT HIPOTECARIO IV, F.T.H.	ES0312370002	AYT.HIP.IV/VAR BTH 20330613 A GTIA	13/06/2033	V	7.738,25
AYT HIPOTECARIO MIXTO II, F.T.A.	ES0370151039	AYT.HIP.MIX.II/VAR BTA 20360620 CH2	20/06/2036	V	99.938,66
AYT ICO-FTVPO I, F.T.A.	ES0312305008	AYT.ICO-FTVPO.I/VAR BTA 20490120 AG	20/01/2049	V	22.621,13
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, F.T.A.	ES0370153001	KUTXA.HIP.I/VAR BTA 20410422 A GTIA	22/04/2041	V	40.096,92
BANCAJA 10, F.T.A.	ES0312872015	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 A2 GTIA	22/05/2050	V	34.756,62
BANCAJA 10, F.T.A.	ES0312872049	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 C GTIA	22/05/2050	V	23.131,41
BANCAJA 11, F.T.A.	ES0312867015	BANCAJA.11/VAR BTA 20500427 A2 GTIA	27/04/2050	V	42.975,15
BANCAJA 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312882006	BANCAJA.3/VAR BTA 20340623 A GTIA	23/06/2034	V	13.049,67
BANCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0312883004	BANCAJA.4/VAR BTH 20340618 A GTIA	18/06/2034	V	10.293,35
BANCAJA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312884002	BANCAJA.5/VAR BTA 20350418 A GTIA	18/04/2035	V	12.675,68
BANCAJA 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312885017	BANCAJA.6/VAR BTA 20360220 A2 GTIA	20/02/2036	V	14.312,54
BANCAJA 7, F.T.A.	ES0312886015	BANCAJA.7/VAR BTA 20361125 A2 GTIA	25/11/2036	V	20.103,93
BANCAJA 9, F.T.A.	ES0312888011	BANCAJA.9/VAR BTA 20430925 A2 GTIA	25/09/2043	V	29.798,53
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211908	BBVA/2,20 BO 20171010	10/10/2017	2,200	103.218,33
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211916	BBVA/2,35 BO 20180316	16/03/2018	2,350	104.297,98
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313212021	BCO.CAM/4,50 BO 20170309 GTIA	09/03/2017	4,500	49.982,50
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138600U5	SAB/1,095 BO 20160504	04/05/2016	1,095	998,54
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138601F4	SAB/1,00 BO 20160630	30/06/2016	1,000	999,92
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138601N8	SAB/1,00 BO 20160826	26/08/2016	1,000	995,74
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138601O6	SAB/0,90 BO 20160802	02/08/2016	0,900	100.186,23
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138601Q1	SAB/1,00 BO 20161013	13/10/2016	1,000	997,34
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138601R9	SAB/0,80 BO 20160812	12/08/2016	0,800	995,51
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138601W9	SAB/0,80 BO 20161014	14/10/2016	0,800	998,24
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138601X7	SAB/0,75 BO 20161104	04/11/2016	0,750	996,57
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138601Y5	SAB/0,75 BO 20170116	16/01/2017	0,750	994,42
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138602A3	SAB/0,75 BO 20170526	26/05/2017	0,750	992,89
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138602C9	SAB/VAR BOESTR 20201218 9	18/12/2020	V	100.000,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860589	SAB/5,00 BOSUBDCONV 20161028 III	28/10/2016	5,000	0,99
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860597	SAB/5,00 BOSUBDCONV 20171028 IV	28/10/2017	5,000	0,50
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860613	SAB/2,50 BO 20161205	05/12/2016	2,500	102.031,42
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138621X5	SAB/VAR BOESTR 20180724 6	24/07/2018	V	977,90
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138621Y3	SAB/0,75 BO 20161229	29/12/2016	0,750	100.108,82
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0313440143	BTO/4,08 BO 20160323	23/03/2016	4,080	101.024,56
BANKIA, S.A.	ES0313307003	BKIA/3,50 BO 20190117	17/01/2019	3,500	105.220,82
BANKIA, S.A.	ES0313307185	BKIA/1,50 BO 20171009	09/10/2017	1,500	100.074,69
BANKIA, S.A.	ES0313307193	BKIA/1,50 BO 20171110	10/11/2017	1,500	10.000,00
BANKINTER 13, F.T.A.	ES0313270011	BKT.13/VAR BTA 20490717 A2 GTIA	17/07/2049	V	44.401,98
BANKINTER 2 PYME, F.T.A.	ES0313716013	BKT.2.PYME/VAR BTA 20430516 A2 GTIA	16/05/2043	V	6.916,99
BANKINTER 4, F.T.H.	ES0313919005	BKT.4/VAR BTH 20381112 A GTIA	12/11/2038	V	13.791,12
BANKINTER 5, F.T.H.	ES0313920003	BKT.5/VAR BTH 20391112 A GTIA	12/11/2039	V	15.248,79
BANKINTER 8, F.T.A.	ES0313548002	BKT.8/VAR BTA 20401215 A GTIA	15/12/2040	V	21.619,44
BANKINTER 9, F.T.A.	ES0313814016	BKT.9/VAR BTA 20420716 A2P GTIA	16/07/2042	V	30.475,13
BANKINTER, S.A.	ES03136793B0	BKT/1,75 BO 20190610	10/06/2019	1,750	103.047,18
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067086	BBVA GM/CUPCER BOESTR 20170418	18/04/2017	C	24.999,78
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067094	BBVA GM/VAR BOESTR 20181029	29/10/2018	V	100.000,00
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067102	BBVA GM/VAR BOESTR 20181022	22/10/2018	V	100.000,00

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067110	BBVA GM/CUPCER BOESTR 20201218	18/12/2020	C	96.299,80
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067128	BBVA GM/VAR BOESTR 20180529	29/05/2018	V	100.000,00
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067136	BBVA GM/VAR BOESTR 20201202	02/12/2020	V	24.998,85
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067144	BBVA GM/VAR BOESTR 20181228 16	28/12/2018	V	100.000,00
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067151	BBVA GM/VAR BOESTR 20181228 17	28/12/2018	V	100.000,00
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067169	BBVA GM/VAR BOESTR 20201230 21	30/12/2020	V	100.000,00
BBVA HIPOTECARIO 3, F.T.A.	ES0314227028	BBVA.HIP.3/VAR BTA 20381121 B GTIA	21/11/2038	V	61.331,64
BBVA LEASING 1, F.T.A.	ES0314209034	BBVA.LEASING.1/VAR BTA 20310526 C	26/05/2031	V	16.000,00
BBVA RMBS 1, F.T.A.	ES0314147010	BBVA.RMBS1/VAR BTA 20500619 A2 GTIA	19/06/2050	V	42.647,56
BBVA RMBS 2, F.T.A.	ES0314148018	BBVA.RMBS2/VAR BTA 20500917 A2 GTIA	17/09/2050	V	35.370,87
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467779	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20160630 83	30/06/2016	V	50.206,18
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467829	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20161212	12/12/2016	C	27.280,31
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467837	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20161212	12/12/2016	C	27.490,31
BFA TENEDORA DE ACCIONES, S.A.U.	ES0314950694	CA.MADRID/5,25 BO 20160407 GTIA	07/04/2016	5,250	51.075,82
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, F.T.A.	ES0357326000	PENEDES.PYMES.1/VAR BTA 20450928 A	28/09/2045	V	4.373,88
CAIXABANK, S.A.	ES0340609140	CABK/3,25 BO 20160122	22/01/2016	3,250	100.530,26
CAIXABANK, S.A.	ES0340609165	CABK/CUPCER BOESTR 20160324	24/03/2016	C	133.165,60
CAIXABANK, S.A.	ES0340609181	CABK/VAR BOESTR 20160527	27/05/2016	V	122.612,84
CAIXABANK, S.A.	ES0340609199	CABK/3,125 BO 20180514	14/05/2018	3,125	106.412,57
CAIXABANK, S.A.	ES0340609215	CABK/2,50 BO 20170418	18/04/2017	2,500	103.048,20
CAIXABANK, S.A.	ES0340609314	CABK/VAR BOESTR 20160613 18	13/06/2016	V	115.018,77
CAIXABANK, S.A.	ES0340609439	CABK/VAR BOESTR 20160808	08/08/2016	V	113.868,15
CAIXABANK, S.A.	ES0340609645	CABK/VAR BOESTR 20161205	05/12/2016	C	106.268,32
CAIXABANK, S.A.	ES0340609702	CABK/CUPCER BOESTR 20170216	16/02/2017	C	101.745,92
CAIXABANK, S.A.	ES0340609710	CABK/CUPCER BOESTR 20200401	01/04/2020	C	92.257,23
CAIXABANK, S.A.	ES0340609728	CABK/CUPCER BOESTR 20200519	19/05/2020	C	92.060,47
CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, F.T.A.	ES0318822006	CED.POP.3/4,25 BTA 20170426 GTIA	26/04/2017	4,250	105.608,97
CEDULAS TDA 3, F.T.A.	ES0317043000	CED.TDA.3/4,38 BTA 20160303 1 GTIA	03/03/2016	4,375	101.385,20
CEDULAS TDA 5, F.T.A.	ES0317045005	CED.TDA.5/4,13 BTA 20191129 A GTIA	29/11/2019	4,125	114.478,44
CEDULAS TDA 6, F.T.A.	ES0317046003	CED.TDA.6/3,88 BTA 20250523 GTIA	23/05/2025	3,875	119.683,04
CEDULAS TDA 7, F.T.A.	ES0317047001	CED.TDA.7/3,50 BTA 20170620 GTIA	20/06/2017	3,500	105.070,77
CRITERIA CAIXAHOLDING, S.A.U.	ES0314970239	LACAIXA/2,375 BO 20190509	09/05/2019	2,375	103.189,84
DRIVER ESPAÑA TWO, F.T.	ES0305094007	DRIVER TWO/VAR BTA 20260821 A GTIA	21/08/2026	V	92.748,37
DRIVER ESPAÑA TWO, F.T.	ES0305094015	DRIVER TWO/0,9418 BTA 20260821 B	21/08/2026	0,942	100.000,00
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014047	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20160509 8	09/05/2016	V	1.024,06
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014054	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20160615 10	15/06/2016	V	997,62
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014104	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20190710 14	10/07/2019	V	994,80
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014179	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20171030 25	30/10/2017	V	959,88
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014237	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20171124 33	24/11/2017	V	957,99
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014369	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20200212 43	12/02/2020	V	988,44
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014377	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20180205 42	05/02/2018	V	981,90
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014385	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20180219 44	19/02/2018	V	958,60
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014393	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20200416 46	16/04/2020	V	984,49
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014401	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20190401 45	01/04/2019	V	953,33
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014419	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20180514 47	14/05/2018	V	969,37
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014427	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20200527 48	27/05/2020	V	973,89
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014435	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20180806 50	06/08/2018	V	999,59
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014443	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20180917 51	17/09/2018	V	1.001,51
F.T.A. PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZACION DE CEDULAS HIPOTECARIAS	ES0334699008	PRG.IND.CED.HIP/5,125 BTA 20220720	20/07/2022	5,125	126.886,90
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS RMBS PRADO 1	ES0305073001	RMBS PRADO 1/VAR BTA 20550615 GTIA	15/06/2055	V	95.010,51
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMPRESAS 2	ES0338058037	SAN.EMPR.2/VAR BTA 20500623 C GTIA	23/06/2050	V	60.509,24
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPOTECARIO 2	ES0382042002	SAN.HIP.2/VAR BTA 20490118 A GTIA	18/01/2049	V	29.407,06
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 8	ES0338446000	UCI.8/VAR BTA 20331218 A GTIA	18/12/2033	V	9.829,15
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 9	ES0338222005	UCI.9/VAR BTA 20350619 A GTIA	19/06/2035	V	13.108,70
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, UCI 15	ES0380957003	UCI.15/VAR BTA 20481218 A GTIA	18/12/2048	V	32.300,36
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641023	FADE/5,90 BTA 20210317 3 GTIA	17/03/2021	5,900	125.220,79
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641031	FADE/5,60 BTA 20180917 4 GTIA	17/09/2018	5,600	114.717,98
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641056	FADE/5,00 BTA 20261217 6 GTIA	17/12/2026	5,000	126.593,00
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641080	FADE/6,25 BTA 20250317 9 GTIA	17/03/2025	6,250	136.340,00
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641114	FADE/4,875 BTA 20171217 12 GTIA	17/12/2017	4,875	109.478,87
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641130	FADE/4,125 BTA 20170317 14 GTIA	17/03/2017	4,125	105.294,33
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641155	FADE/3,875 BTA 20180317 16 GTIA	17/03/2018	3,875	108.150,38
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641163	FADE/2,875 BTA 20160917 17 GTIA	17/09/2016	2,875	102.420,15
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641171	FADE/3,375 BTA 20190317 18 GTIA	17/03/2019	3,375	108.748,67
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641189	FADE/2,25 BTA 20161217 19 GTIA	17/12/2016	2,250	102.261,58
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641197	FADE/1,875 BTA 20170917 20 GTIA	17/09/2017	1,875	102.992,67
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641205	FADE/0,85 BTA 20190917 21 GTIA	17/09/2019	0,850	100.435,49
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, F.T.A.	ES0378641213	FADE/1,45 BTA 20220617 22 GTIA	17/06/2022	1,450	99.763,00
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 12	ES0338147004	UCI.12/VAR BTH 20391215 A GTIA	15/12/2039	V	26.761,73
GC FTPYME PASTOR 4, F.T.A.	ES0332233032	GC.PYME.PAS.4/VAR BTA 20450715 B	15/07/2045	V	17.053,14
GC SABADELL 1, F.T.H.	ES0316874017	GC.SAB.1/VAR BTH 20380620 A2 GTIA	20/06/2038	V	20.588,40
IM CAJA LABORAL 1, F.T.A.	ES0347565006	IM.CALABORAL.1/VAR BTA 20491024 A	24/10/2049	V	32.979,76
IM CAJAMAR EMPRESAS 5, F.T.A.	ES0347431001	CAJAMAR.EMP.5/3,178 BTA 22551120 A1	22/11/2055	3,178	16.472,97
IM CEDULAS 10, F.T.A.	ES0349045007	IM.CED.10/4,50 BTA 20220221 GTIA	21/02/2022	4,500	120.937,23
IM CEDULAS 5, F.T.A.	ES0347849004	IM.CEDULAS.5/3,50 BTA 20200615 GTIA	15/06/2020	3,500	112.425,42
IM CEDULAS 7, F.T.A.	ES0347784003	IM.CED.7/4,00 BTA 20210331 GTIA	31/03/2021	4,000	116.711,04
IM CEDULAS 9, F.T.A.	ES0347785000	IM.CED.9/4,25 BTA 20160609 GTIA	09/06/2016	4,250	102.138,52
IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, F.T.A.	ES0347843023	IM.POP.EMP.1/VAR BTA 20330321 B	21/03/2033	V	81.613,56

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
IM PASTOR 2, F.T.H.	ES0347861009	IM PASTOR 2/VAR BTH 20410922 A GTIA	22/09/2041	V	13.805,99
IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, F.T.A.	ES0347787006	IM.PREST.F.CED./VAR BTA 20220124 A	24/01/2022	V	19.208,32
KUTXABANK, S.A.	ES0314100076	BBK4,40 BO 20160301	01/03/2016	4,400	101.174,23
KUTXABANK, S.A.	ES0343307007	KUTXABANK/VAR BO 20170424	24/04/2017	V	100.735,39
MADRID RMBS 1, F.T.A.	ES0359091016	MADRID.RMBS.I/VAR BTA 20490622 A2	22/06/2049	V	44.861,12
MBS BANCAJA 4, F.T.A.	ES0361797022	MBS.BANCAJA.4/VAR BTA 20500723 A3	23/07/2050	V	32.401,51
MELIA HOTELS INTERNATIONAL, S.A.	ES0376252005	MEL/7,80 BO 20160731	31/07/2016	7,800	97,30
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622004	PROG.CED.TDA/VAR BTA 20160408 A1	08/04/2016	V	99.858,90
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622012	PROG.CED.TDA/4,13 BTA 20210410 A4	10/04/2021	4,125	117.136,81
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622020	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20310410 A6	10/04/2031	4,250	122.042,19
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622038	PROG.CED.TDA/4,00 BTA 20181023 A3	23/10/2018	4,000	110.633,67
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622046	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20270328 A5	28/03/2027	4,250	125.021,89
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, F.T.A.	ES0374273003	RURAL.HIP.GBL.I/VAR BTA 20390118 A	18/01/2039	V	22.882,86
RURAL HIPOTECARIO IV, F.T.H.	ES0358283002	RURAL.HIP.IV/VAR BTH 20330213 A	13/02/2033	V	8.363,53
RURAL HIPOTECARIO V, F.T.H.	ES0358284000	RURAL.HIP.V/VAR BTH 20350315 A1	15/03/2035	V	18.993,30
RURALPYME 2 FTPYME, F.T.A.	ES0374352021	RURALPYME.2/VAR BTA 20300425 B	25/04/2030	V	81.402,79
SANTANDER HIPOTECARIO I, F.T.A.	ES0309364000	SAN.HIP.I/VAR BTA 20420715 A GTIA	15/07/2042	V	16.076,61
SOCIEDAD DE GESTION DE ACTIVOS PROC. DE LA REESTR. BANCARIA, S.A.	ES0352506119	SAREB/VAR BO 20170228 2015-2	28/02/2017	V	99.952,40
TDA 13-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377977006	TDA 13-MIXTO/VAR BTH 20151026 A1	26/10/2015	V	3.601,57
TDA 13-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377977022	TDA 13-MIXTO/VAR BTH 20151026 A2	26/10/2015	V	3.076,78
TDA 14-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377978020	TDA 14-MIXTO/VAR BTH 20310126 A3	26/01/2031	V	8.707,73
TDA 14-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377978046	TDA 14-MIXTO/VAR BTH 20310126 AN	26/01/2031	V	4.914,99
TDA 15-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377979002	TDA.15-MIX/VAR BTA 20320628 A1 GTIA	28/06/2032	V	9.773,61
TDA 15-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377979028	TDA.15-MIX/VAR BTA 20420627 A2 GTIA	27/06/2042	V	12.092,00
TDA 16-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377973005	TDA.16-MIX/VAR BTA 20350322 A1 GTIA	22/03/2035	V	8.919,63
TDA 17-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377988003	TDA 17-MIXTO/VAR BTA 20350922 A1	22/09/2035	V	8.490,67
TDA 18-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377989001	TDA 18-MIXTO/VAR BTA 20450622 A1	22/06/2045	V	14.935,76
TDA 20-MIXTO, F.T.A.	ES0377981032	TDA.20-MIX/VAR BTA 20360426 B2 GTIA	26/04/2036	V	80.270,00
TDA 22-MIXTO, F.T.A.	ES0377983012	TDA 22-MIXTO/VAR BTA 20460628 A1B	28/06/2046	V	64.231,36
TDA 25, F.T.A.	ES0377929007	TDA.25/VAR BTA 20410322 A GTIA	22/03/2041	V	24.641,91
TDA 28, F.T.A.	ES0377930005	TDA.28/VAR BTA 20501028 A GTIA	28/10/2050	V	35.519,33
TDA CAJAMAR 2, F.T.A.	ES0377965019	TDA.CAJAMAR.2/VAR BTA 20410626 A2	26/06/2041	V	7.149,34
TDA CAM 2, F.T.A.	ES0338449004	TDA CAM 2, FTA/VAR BTA 20321026 A	26/10/2032	V	11.780,68
TDA CAM 5, F.T.A.	ES0377992005	TDA.CAM.5/VAR BTA 20431026 A GTIA	26/10/2043	V	28.569,79
TDA CAM 6, F.T.A.	ES0377993011	TDA.CAM.6/VAR BTA 20160428 A2 GTIA	28/04/2016	V	8.248,63
TDA CAM 6, F.T.A.	ES0377993029	TDA.CAM.6/VAR BTA 20440428 A3 GTIA	28/04/2044	V	43.760,74
TDA CAM 8, F.T.A.	ES0377986009	TDA.CAM.8/VAR BTA 20490226 A GTIA	26/02/2049	V	32.844,97
TDA IBERCAJA 1, F.T.A.	ES0338450002	TDA IBERCAJA 1/VAR BTA 20350726 A	26/07/2035	V	17.327,54
TDA IBERCAJA 2, F.T.A.	ES0338451000	TDA IBERCAJA 2/VAR BTA 20421026 A	26/10/2042	V	30.007,05
TDA IBERCAJA 3, F.T.A.	ES0338452008	TDA.IBERCAJA.3/VAR BTA 20431228 A	28/12/2043	V	33.490,92
TDA IBERCAJA 3, F.T.A.	ES0338452024	TDA.IBERCAJA.3/VAR BTA 20431228 C	28/12/2043	V	56.775,25
TDA IBERCAJA 6, F.T.A.	ES0377968005	TDA.IBERCAJA.6/VAR BTA 20511125 A	25/11/2051	V	51.481,78
TDA PASTOR 1, F.T.A.	ES0377980018	TDA PASTOR 1/VAR BTA 20381228 A2	28/12/2038	V	89.945,85
VALENCIA HIPOTECARIO 1, F.T.A.	ES0382744003	VALENCIA.HIP.1/VAR BTA 20360224 A	24/02/2036	V	16.005,51

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	110.950,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211071	BBVA/4,00 CEDHIP 20250225 GTIA	25/02/2025	4,000	125.487,43
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211105	BBVA/3,50 CEDHIP 20201007 GTIA	07/10/2020	3,500	114.967,49
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211113	BBVA/3,25 CEDHIP 20160124 GTIA	24/01/2016	3,250	100.524,59
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211121	BBVA/3,50 CEDHIP 20210124 GTIA	24/01/2021	3,500	115.548,25
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211170	BBVA/4,25 CEDHIP 20170118 GTIA	18/01/2017	4,250	105.070,96
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211220	BBVA/5,05 CEDTER 20170710 GTIA	10/07/2017	5,050	54.095,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211345	BBVA/3,625 CEDHIP 20170118 GTIA	18/01/2017	3,625	52.084,35
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211428	BBVA/4,75 CEDHIP 20160210 GTIA	10/02/2016	4,750	50.639,76
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211782	BBVA/3,50 CEDHIP 20171205 GTIA	05/12/2017	3,500	107.094,69
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211790	BBVA/3,875 CEDHIP 20230130 GTIA	30/01/2023	3,875	121.584,85
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211816	BBVA/2,25 CEDHIP 20240612 GTIA	12/06/2024	2,250	100.760,02
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211824	BBVA/0,75 CEDHIP 20220120 GTIA	20/01/2022	0,750	99.796,80
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211865	BBVA/0,625 CEDHIP 20210517 GTIA	17/05/2021	0,625	99.569,80
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860034	SAB/3,50 CEDHIP 20160119 GTIA	19/01/2016	3,500	100.871,70
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860067	SAB/4,25 CEDHIP 20170124 GTIA	24/01/2017	4,250	104.944,14
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860323	SAB/3,375 CEDHIP 20180123 GTIA	23/01/2018	3,375	107.009,89
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860398	SAB/0,875 CEDHIP 20211112 GTIA	12/11/2021	0,875	99.773,24
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860414	SAB/VAR CEDHIP 20190129 GTIA	29/01/2019	V	99.587,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860422	SAB/VAR CEDHIP 20190423 GTIA	23/04/2019	V	99.021,04
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860455	SAB/0,375 CEDHIP 20200610 GTIA	10/06/2020	0,375	99.541,91
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860489	SAB/VAR CEDHIP 20200720 GTIA	20/07/2020	V	98.025,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860505	SAB/0,625 CEDHIP 20201103 GTIA	03/11/2020	0,625	99.563,17
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860513	SAB/VAR CEDTER 20191216 GTIA	16/12/2019	V	100.000,00
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0413056047	BMN/3,125 CEDHIP 20190121 GTIA	21/01/2019	3,125	108.676,03
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790017	POP/4,00 CEDHIP 20161018 GTIA	18/10/2016	4,000	103.392,56
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790074	POP/4,125 CEDHIP 20180409 GTIA	09/04/2018	4,125	54.477,20
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790173	POP/4,125 CEDHIP 20170330 GTIA	30/03/2017	4,125	105.523,70
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790231	POP/3,75 CEDHIP 20190122 GTIA	22/01/2019	3,750	110.930,64
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790314	POP/3,50 CEDHIP 20170911 GTIA	11/09/2017	3,500	105.820,79
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790355	POP/2,125 CEDHIP 20191008 GTIA	08/10/2019	2,125	106.014,92
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790397	POP/1,00 CEDHIP 20250407 GTIA	07/04/2025	1,000	95.339,30
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790413	POP/0,75 CEDHIP 20200929 GTIA	29/09/2020	0,750	99.949,45
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790421	POP/0,875 CEDHIP 20210928 GTIA	28/09/2021	0,875	99.760,48
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440027	BTO/5,75 CEDHIP 20170327 GTIA	27/03/2017	5,750	107.330,00
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440084	BTO/3,50 CEDHIP 20160118 GTIA	18/01/2016	3,500	100.698,81
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413440308	BTO/4,75 CEDHIP 20170124 GTIA	24/01/2017	4,750	105.251,60
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900061	SAN/4,50 CEDHIP 20160729 GTIA	29/07/2016	4,500	103.342,29
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900087	SAN/4,00 CEDHIP 20200407 GTIA	07/04/2020	4,000	115.796,07
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900129	SAN/3,875 CEDHIP 20260206 GTIA	06/02/2026	3,875	124.327,45
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900145	SAN/4,125 CEDHIP 20170109 GTIA	09/01/2017	4,125	104.605,34
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900160	SAN/4,625 CEDHIP 20270504 GTIA	04/05/2027	4,625	133.095,90
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900210	SAN/3,625 CEDHIP 20170406 GTIA	06/04/2017	3,625	104.689,51
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900228	SAN/4,625 CEDHIP 20160120 GTIA	20/01/2016	4,625	100.634,05
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900251	SAN/4,625 CEDTER 20160621 GTIA	21/06/2016	4,625	102.550,97
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900327	SAN/2,875 CEDHIP 20180130 GTIA	30/01/2018	2,875	106.066,70
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900368	SAN/1,125 CEDHIP 20241127 GTIA	27/11/2024	1,125	99.588,81
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900376	SAN/2,00 CEDHIP 20341127 GTIA	27/11/2034	2,000	99.792,66
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900384	SAN/0,75 CEDHIP 20220909 GTIA	09/09/2022	0,750	99.798,17
BANKIA, S.A.	ES0413307093	BKIA/1,00 CEDHIP 20250925 GTIA	25/09/2025	1,000	94.481,54
BANKIA, S.A.	ES0413307101	BKIA/1,125 CEDHIP 20220805 GTIA	05/08/2022	1,125	100.314,34
BANKIA, S.A.	ES0414950560	CA.MADRID/5,75 CEDHIP 20160629 GTIA	29/06/2016	5,750	103.356,16
BANKIA, S.A.	ES0414950628	CA.MADRID/4,00 CEDHIP 20250203 GTIA	03/02/2025	4,000	122.904,02
BANKIA, S.A.	ES0414950644	CA.MADRID/4,125 CEDHIP 20360324	24/03/2036	4,125	62.942,90
BANKIA, S.A.	ES0414950651	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20180525 GTIA	25/05/2018	4,250	55.152,03
BANKIA, S.A.	ES0414950669	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20160705 GTIA	05/07/2016	4,250	51.273,09
BANKIA, S.A.	ES0414950685	CA.MADRID/4,50 CEDHIP 20220426 GTIA	26/04/2022	4,500	61.205,16
BANKIA, S.A.	ES0414950693	CA.MADRID/5,00 CEDHIP 20190628 GTIA	28/06/2019	5,000	58.466,38
BANKIA, S.A.	ES0414950776	CA.MADRID/3,625 CEDHIP 20161005	05/10/2016	3,625	51.550,58
BANKINTER, S.A.	ES0413679178	BKT/4,125 CEDHIP 20170322 GTIA	22/03/2017	4,125	52.775,18
BANKINTER, S.A.	ES0413679269	BKT/2,75 CEDHIP 20160726 GTIA	26/07/2016	2,750	101.819,23
BANKINTER, S.A.	ES0413679277	BKT/3,125 CEDHIP 20180205 GTIA	05/02/2018	3,125	106.494,67
BANKINTER, S.A.	ES0413679327	BKT/1,00 CEDHIP 20250205 GTIA	05/02/2025	1,000	97.664,71
BANKINTER, S.A.	ES0413679343	BKT/0,875 CEDHIP 20220803 GTIA	03/08/2022	0,875	99.826,49
BANKINTER, S.A.	ES0413679350	BKT/0,625 CEDHIP 20201009 GTIA	09/10/2020	0,625	99.667,35
CAIXABANK, S.A.	ES0413985021	BARCLAYS/VAR CEDHIP 20190627 GTIA	27/06/2019	V	49.939,04
CAIXABANK, S.A.	ES0414970196	LACAIXA/4,75 CEDHIP 20181031 GTIA	31/10/2018	4,750	113.135,02
CAIXABANK, S.A.	ES0414970204	LACAIXA/3,875 CEDHIP 20250217 GTIA	17/02/2025	3,875	122.609,68
CAIXABANK, S.A.	ES0414970220	LACAIXA/VAR CEDHIP 20180109 GTIA	09/01/2018	V	99.151,46
CAIXABANK, S.A.	ES0414970246	LACAIXA/3,625 CEDHIP 20210118 GTIA	18/01/2021	3,625	57.824,19
CAIXABANK, S.A.	ES0414970253	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160630 GTIA	30/06/2016	V	996,37
CAIXABANK, S.A.	ES0414970295	LACAIXA/4,25 CEDHIP 20170126 GTIA	26/01/2017	4,250	52.297,70
CAIXABANK, S.A.	ES0414970303	LACAIXA/4,50 CEDHIP 20220126 GTIA	26/01/2022	4,500	61.260,54
CAIXABANK, S.A.	ES0414970337	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160930 GTIA	30/09/2016	V	997,00
CAIXABANK, S.A.	ES0414970345	LACAIXA/VAR CEDHIP 20161128 GTIA	28/11/2016	V	49.998,24
CAIXABANK, S.A.	ES0414970352	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170330 GTIA	30/03/2017	V	993,14
CAIXABANK, S.A.	ES0414970378	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170320 GTIA	20/03/2017	V	50.000,00
CAIXABANK, S.A.	ES0414970394	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170930 GTIA	30/09/2017	V	995,11

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
CAIXABANK, S.A.	ES0414970402	LACAIXA/4,625 CEDHIP 20190604 GTIA	04/06/2019	4,625	57.564,55
CAIXABANK, S.A.	ES0414970535	LACAIXA/3,50 CEDHIP 20160331 GTIA	31/03/2016	3,500	50.666,15
CAIXABANK, S.A.	ES0414970659	LACAIXA/5,00 CEDHIP 20160222 GTIA	22/02/2016	5,000	50.642,49
CAIXABANK, S.A.	ES0414970683	LACAIXA/5,125 CEDHIP 20160427 GTIA	27/04/2016	5,125	51.211,41
CAIXABANK, S.A.	ES0440609040	CABK/4,00 CEDHIP 20170216 GTIA	16/02/2017	4,000	104.787,74
CAIXABANK, S.A.	ES0440609206	CABK/3,00 CEDHIP 20180322 GTIA	22/03/2018	3,000	106.564,94
CAIXABANK, S.A.	ES0440609248	CABK/2,625 CEDHIP 20240321 GTIA	21/03/2024	2,625	112.071,08
CAIXABANK, S.A.	ES0440609271	CABK/0,625 CEDHIP 20250327 GTIA	27/03/2025	0,625	94.373,50
CAIXABANK, S.A.	ES0440609305	CABK/0,625 CEDHIP 20201112 GTIA	12/11/2020	0,625	99.899,74
CAJA RURAL DE CASTILLA-LA MANCHA, S. COOP. DE CREDITO	ES0457089003	CR.C.MANCHA/0,875 CEDHIP 20211001	01/10/2021	0,875	99.700,94
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0415306002	CR NAV/2,875 CEDHIP 20180611 GTIA	11/06/2018	2,875	106.648,52
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0415306036	CR NAV/0,50 CEDHIP 20220316 GTIA	16/03/2022	0,500	98.900,97
CAJAS RURALES UNIDAS, SOCIEDAD COOP. DE CREDITO	ES0422714016	CRU/3,375 CEDHIP 20160516 GTIA	16/05/2016	3,375	101.375,80
CAJAS RURALES UNIDAS, SOCIEDAD COOP. DE CREDITO	ES0422714024	CRU/3,75 CEDHIP 20181122 GTIA	22/11/2018	3,750	109.537,17
CAJAS RURALES UNIDAS, SOCIEDAD COOP. DE CREDITO	ES0422714032	CRU/1,25 CEDHIP 20220126 GTIA	26/01/2022	1,250	99.695,07
CAJAS RURALES UNIDAS, SOCIEDAD COOP. DE CREDITO	ES0422714040	CRU/1,00 CEDHIP 20201022 GTIA	22/10/2020	1,000	99.550,95
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0414840274	CA.CATALUNYA/3,50 CEDHIP 20160307	07/03/2016	3,500	100.886,09
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0414840308	CA.CATALUNYA/4,875 CEDHIP 20170629	29/06/2017	4,875	107.355,60
DEUTSCHE BANK, S.A.E.	ES0413320047	DT.BK.SAE/VAR CEDHIP 20240705 GTIA	05/07/2024	V	49.522,20
DEUTSCHE BANK, S.A.E.	ES0413320054	DT.BK.SAE/0,625 CEDHIP 20201125	25/11/2020	0,625	99.942,43
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0414954174	IBERCAJA/4,50 CEDHIP 20200731 GTIA	31/07/2020	4,500	58.525,00
KUTXABANK, S.A.	ES0414100059	BBK/4,55 CEDHIP 20200930 GTIA	30/09/2020	4,550	118.105,23
KUTXABANK, S.A.	ES0443307014	KUTXABANK/3,00 CEDHIP 20170201 GTIA	01/02/2017	3,000	103.425,30
KUTXABANK, S.A.	ES0443307048	KUTXABANK/1,75 CEDHIP 20210527 GTIA	27/05/2021	1,750	105.994,15
KUTXABANK, S.A.	ES0443307063	KUTXABANK/1,25 CEDHIP 20250922 GTIA	22/09/2025	1,250	99.233,71
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0413495005	SAN.CONS.FIN/3,875 CEDHIP 20160323	23/03/2016	3,875	101.590,00
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0458759034	UNICAJA/5,50 CEDHIP 20160323 GTIA	23/03/2016	5,500	51.091,89

PAGARÉS

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862AN6	SAB/PAG 20161005	05/10/2016	C	994,49
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862BH6	SAB/PAG 201611102	02/11/2016	C	994,09
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862BR5	SAB/PAG 20161130	30/11/2016	C	994,08
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862M54	SAB/PAG 20160106	06/01/2016	C	999,33
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862N53	SAB/PAG 20160120	20/01/2016	C	999,78
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862O11	SAB/PAG 20160127	27/01/2016	C	999,57
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862P28	SAB/PAG 20160217	17/02/2016	C	998,36
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862R00	SAB/PAG 20160316	16/03/2016	C	999,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862S90	SAB/PAG 20160427	27/04/2016	C	998,45
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862T57	SAB/PAG 20160511	11/05/2016	C	998,73
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862U05	SAB/PAG 20160518	18/05/2016	C	997,05
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513862X28	SAB/PAG 20160713	13/07/2016	C	997,59
BANKINTER, S.A.	ES0513679ZP6	BKT/PAG 20160203	03/02/2016	C	999,75
BANKINTER, S.A.	ES0513689309	BKT/PAG 20160210	10/02/2016	C	999,91
BANKINTER, S.A.	ES0513689838	BKT/PAG 20160429	29/04/2016	C	999,25
BANKINTER, S.A.	ES0513689846	BKT/PAG 20160125	25/01/2016	C	999,91
CAIXABANK, S.A.	ES05406098Z1	CABK/PAG 20160712	12/07/2016	C	996,73
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO KUTXABANK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0515306DB1	CR NAV/PAG 20160113	13/01/2016	C	99.966,79
KUTXABANK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134247P4	KUTXA.EMPTOS/PAG 20161111	11/11/2016	C	99.850,63
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495MH2	SAN.CONS.FIN/PAG 20160222	22/02/2016	C	99.956,24
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495NB3	SAN.CONS.FIN/PAG 20160505	05/05/2016	C	99.875,02
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495NE7	SAN.CONS.FIN/PAG 20160603	03/06/2016	C	99.882,93
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495NP3	SAN.CONS.FIN/PAG 20160229	29/02/2016	C	99.976,96
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495OF2	SAN.CONS.FIN/PAG 20160323	23/03/2016	C	99.895,33
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495OK2	SAN.CONS.FIN/PAG 20160729	29/07/2016	C	99.750,19
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495OM8	SAN.CONS.FIN/PAG 20160331	31/03/2016	C	99.899,83
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495OQ9	SAN.CONS.FIN/PAG 20160810	10/08/2016	C	99.770,36
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495OS5	SAN.CONS.FIN/PAG 20160205	05/02/2016	C	99.953,67
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495OU1	SAN.CONS.FIN/PAG 20160912	12/09/2016	C	99.781,63
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495OV9	SAN.CONS.FIN/PAG 20160129	29/01/2016	C	99.961,58
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495OX5	SAN.CONS.FIN/PAG 20160930	30/09/2016	C	99.655,03
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495OY3	SAN.CONS.FIN/PAG 20170331	31/03/2017	C	99.263,14
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495OZ0	SAN.CONS.FIN/PAG 20170405	05/04/2017	C	99.258,05
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PA0	SAN.CONS.FIN/PAG 20161006	06/10/2016	C	99.627,24
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PB8	SAN.CONS.FIN/PAG 20160115	15/01/2016	C	99.953,67
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PC6	SAN.CONS.FIN/PAG 20160414	14/04/2016	C	99.864,07
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PD4	SAN.CONS.FIN/PAG 20170412	12/04/2017	C	99.106,84
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PE2	SAN.CONS.FIN/PAG 20171005	05/10/2017	C	98.616,68
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PF9	SAN.CONS.FIN/PAG 20160122	22/01/2016	C	99.954,86
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PG7	SAN.CONS.FIN/PAG 20161014	14/10/2016	C	99.601,67
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PH5	SAN.CONS.FIN/PAG 20161021	21/10/2016	C	99.609,14
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PI3	SAN.CONS.FIN/PAG 20170428	28/04/2017	C	99.626,23
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PJ1	SAN.CONS.FIN/PAG 20161031	31/10/2016	C	99.623,74
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PK9	SAN.CONS.FIN/PAG 20171030	30/10/2017	C	98.701,85
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PL7	SAN.CONS.FIN/PAG 20161107	07/11/2016	C	99.626,23
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PM5	SAN.CONS.FIN/PAG 20170505	05/05/2017	C	99.201,92
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PN3	SAN.CONS.FIN/PAG 20160513	13/05/2016	C	99.870,52
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PO1	SAN.CONS.FIN/PAG 20171114	14/11/2017	C	98.714,32
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PP8	SAN.CONS.FIN/PAG 20160523	23/05/2016	C	99.877,85
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PQ6	SAN.CONS.FIN/PAG 20161114	14/11/2016	C	99.684,39
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PR4	SAN.CONS.FIN/PAG 20161123	23/11/2016	C	99.683,46
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PS2	SAN.CONS.FIN/PAG 20160530	30/05/2016	C	99.916,23
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PT0	SAN.CONS.FIN/PAG 20170606	06/06/2017	C	99.323,28
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PU8	SAN.CONS.FIN/PAG 20171130	30/11/2017	C	98.956,97
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PV6	SAN.CONS.FIN/PAG 20161130	30/11/2016	C	99.703,35
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PW4	SAN.CONS.FIN/PAG 20160906	06/09/2016	C	99.851,18
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PX2	SAN.CONS.FIN/PAG 20170310	10/03/2017	C	99.552,76
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PY0	SAN.CONS.FIN/PAG 20161222	22/12/2016	C	99.714,79
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495PZ7	SAN.CONS.FIN/PAG 20161228	28/12/2016	C	99.701,71
TELEFONICA, S.A.	ES0578430MA6	TEF/PAG 20160407	07/04/2016	C	99.941,87
TELEFONICA, S.A.	ES0578430MB4	TEF/PAG 20160408	08/04/2016	C	99.941,37
TELEFONICA, S.A.	ES0578430MC2	TEF/PAG 20160506	06/05/2016	C	99.950,16
TELEFONICA, S.A.	ES0578430MD0	TEF/PAG 20160519	19/05/2016	C	99.960,13
TELEFONICA, S.A.	ES0578430ME8	TEF/PAG 20160923	23/09/2016	C	99.939,76

PARTICIPACIONES PREFERENTES

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio en Euros
BANKINTER EMISIONES, S.A.U.	ES0113549002	BKT.EM/VAR NACU AMTB PPR I		V	47,18
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL LTD.	KYG1280W1015	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	800,45
CAIXASABADELL PREFERENTES, S.A.U.	ES0101339028	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	40.180,20
DEOLEO PREFERENTES, S.A.U.	ES0130124003	DEOLEO.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	26.756,79
PASTOR PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.U.	ES0168596004	PASTOR.PREF/VAR NACU AMTB PPR 1		V	100,90
POPULAR CAPITAL, S.A.	ES0170412003	POP.CAP./VAR NACU AMTB PPR D		V	92,88
UNION FENOSA FINANCIAL SERVICES USA, L.L.C.	USU90716AA64	UNF.FINL.USA/VAR NACU AMTB PPR	22/02/2016	V	24,36

RENTA VARIABLE

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Valor Medio en Euros
1NKEMIA IUCT GROUP, S.A.	ES0156303002	IKM/AC 0,10	1,94
AB-BIOTICS, S.A.	ES0109659013	AB-BIOTICS/AC 0,05	1,94
ABENGOA, S.A.	ES0105200002	ABG/AC B 0,0002	0,68
ABENGOA, S.A.	ES0105200416	ABG/AC A 0,02	1,02
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0111845014	ABE/AC 3,00	14,46
ACCIONA, S.A.	ES0125220311	ANA/AC 1,00	75,68
ACERINOX, S.A.	ES0132105018	ACX/AC 0,25	9,70
ACS, ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS, S.A.	ES0167050915	ACS/AC 0,50	29,08
ADOLFO DOMINGUEZ, S.A.	ES0106000013	ADZ/AC 0,60	3,74
ADVEO GROUP INTERNATIONAL, S.A.	ES0182045312	ADV/AC 1,50	5,80
AENA, S.A.	ES0105046009	AENA/AC 10,00	103,41
AGILE CONTENT, S.A.	ES0105102000	AGILE CONTENT/AC 0,10	1,81
AGROFRUSE-MEDITERRANEAN AGRICULTURAL GROUP, S.A.	ES0106325014	AGROFRUSE/AC 3,01	15,75
AIRBUS GROUP, S.E.	NL0000235190	AC. AIRBUS	62,11
ALFA, S.A.B. DE C.V.	MXP000511016	AC. ALFA S/A	2,00
ALMIRALL, S.A.	ES0157097017	ALM/AC 0,12	17,26
ALTIA CONSULTORES, S.A.	ES0113312005	ALTIA.CONSULTI/AC 0,02	12,23
AMADEUS IT HOLDING, S.A.	ES0109067019	AMS/AC A 0,01	38,75
AMERICA MOVIL, S.A.B. DE C.V.	MXP001691213	AC. AMERICA MOVIL. S/L	0,75
AMPER, S.A.	ES0109260531	AMP/AC 0,05	0,14
APERAM SOCIETE ANONYME	LU0569974404	APAM/AC SVN	30,43
APPLUS SERVICES, S.A.	ES0105022000	APPS/AC 0,10	8,43
ARCELORMITTAL, S.A.	LU0323134006	ARCELORMITTAL/AC SVN	4,68
ATRESMEDIA CORPORACION DE MEDIOS DE COMUNICACION, S.A.	ES0109427734	A3M/AC A 0,75	11,18
AUTONOMY SPAIN REAL ESTATE SOCIMI, S.A.U.	ES0105090007	AUTONOMY SPAIN/AC 1,00	16,75
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI, S.A.	ES0105026001	AXIA/AC 10,00	12,79
AYCO GRUPO INMOBILIARIO, S.A.	ES0152960011	AYCO/AC 0,03	0,23
AZKOYEN, S.A.	ES0112458312	AZK/AC 0,60	3,49
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0113211835	BBVA/AC 0,49	7,60
BANCO BRADESCO, S.A.	BRBBDACACNPR8	AC. BANCO BRADESCO -PREF.-	5,16
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0113860A34	SAB/AC 0,125	1,77
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0113790226	POP/AC 0,50	3,40
BANCO SANTANDER RIO, S.A.	ARBRI0010194	AC. BCO SANTANDER RIO. S/B	2,94
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0113900J37	SAN/AC 0,50	5,00
BANKIA, S.A.	ES0113307021	BKIA/AC 0,80	1,16
BANKINTER, S.A.	ES0113679I37	BKT/AC 0,30	6,73
BARON DE LEY, S.A.	ES0114297015	BDL/AC 0,60	97,49
BAYER A.G.	DE000BAY0017	AC. BAYER	117,59
BBVA BANCO FRANCES, S.A.	ARP125991090	AC. BBVA BCO. FRANCES	7,40
BIOORGANIC RESEARCH AND SERVICES, S.A.	ES0184980003	BNT/AC 0,05	4,83
BIOSEARCH, S.A.	ES0172233118	BIO/AC 0,24	0,46
BODEGAS BILBAINAS, S.A.	ES0114930011	BODEGAS.BILB/AC 6,01	6,85
BODEGAS RIOJANAS, S.A.	ES0115002018	RIO/AC 0,75	4,05
BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOL, SDAD HOLDING DE MDOS Y STMAS FIN., S.A.	ES0115056139	BME/AC 3,00	32,91
BRADESPAR, S.A.	BRBRAPACNOR5	AC. BRADESPAR	1,43
BRADESPAR, S.A.	BRBRAPACNPR2	AC. BRADESPAR -PREF.-	1,64
BRASKEM, S.A.	BRBRKMACNPA4	AC. BRASKEM -PREF.-	5,59
CAIXABANK, S.A.	ES0140609019	CABK/AC 1,00	3,53
CARBURES EUROPE, S.A.	ES0116162068	CARBURES/AC 0,17	0,90
CARTERA INDUSTRIAL REA, S.A.	ES0162292017	CART.IND.REA/AC 2,30	1,83
CATENON, S.A.	ES0112320009	CATENON/AC 0,02	0,94
CELLNEX TELECOM, S.A.	ES0105066007	CLNX/AC 0,25	16,02
CEMENTOS MOLINS, S.A.	ES0117360117	CEMENTOS.MOLINS/AC 0,30	9,09
CEMENTOS PORTLAND VALDERRIVAS, S.A.	ES0117390411	CPL/AC 1,50	4,82
CENTRAIS ELETTRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNOR6	AC. ELETROBRAS	1,34
CENTRAIS ELETTRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNPB7	AC. ELETROBRAS. PREF. S/B	2,44
CIE AUTOMOTIVE, S.A.	ES0105630315	CIE/AC 0,25	14,24
CLINICA BAVIERA, S.A.	ES0119037010	CBAV/AC 0,10	5,40
CODERE, S.A.	ES0119256115	CDR/AC 0,20	1,09
COMMCENTER, S.A.	ES0121071007	COMMCENTER/AC 0,50	1,65
COMPANHIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	BRCMIGACNPR3	AC. CEMIG -PREF.-	1,66
COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	BRCPLEACNPB9	AC. COPEL -PREF.-	7,12
COMPANHIA DE DISTRIBUCION INTEGRAL LOGISTA HOLDINGS, S.A.	ES0105027009	LOG/AC 0,20	18,18
COMPANHIA ESPAÑOLA DE VIVIENDAS EN ALQUILER, S.A.	ES0132955008	CEVASA/AC 0,30	6,11
CONSTRUCCIONES Y AUXILIAR DE FERROCARRILES, S.A.	ES0121975017	CAF/AC 3,01	255,04
CORPORACION EMPRESARIAL DE MATERIALES DE CONSTRUCCION, S.A.	ES0182170615	URA/AC 0,72	0,39
CORPORACION FINANCIERA ALBA, S.A.	ES0117180111	ALB/AC 1,00	40,00
CORPORACION GEO, S.A.B. DE C.V.	MXP3142C1177	AC. GEO. S/B	0,51
DEOLEO, S.A.	ES0110047919	OLE/AC 0,38	0,29
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION, S.A.	ES0126775032	DIA/AC 0,10	5,80
DOGI INTERNATIONAL FABRICS, S.A.	ES0126962002	DGI/AC 0,064	0,93
DURO FELGUERA, S.A.	ES0162600417	MDF/AC 0,50	2,01
EBIOS ENERGY, A.D.	BG1100025128	EBIOS ENERGY/AC 1,00	1,22
EBRO FOODS, S.A.	ES0112501012	EBRO/AC 0,60	17,89
EDREAMS ODIGEO, S.A.	LU1048328220	EDREAMS/AC 0,10	2,31
ELECNOR, S.A.	ES0129743318	ENO/AC 0,10	8,30
ENAGAS, S.A.	ES0130960018	ENG/AC 1,50	27,11
ENCE ENERGIA Y CELULOSA, S.A.	ES0130625512	ENC/AC 0,90	3,39

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Valor Medio en Euros
ENDESA, S.A.	ES0130670112	ELE/AC 1,20	19,45
ENEL GREEN POWER, S.P.A.	IT0004618465	EGPW/AC 0,20	1,88
ENTRECAMPOS CUATRO, SOCIMI, S.A.	ES0131172001	ENTRECAMPOS 4/AC 0,898	1,99
ERCROS, S.A.	ES0125140A14	ECR/AC 0,30	0,68
EUROCONSULT GROUP, S.A.	ES0105042008	EUROCONSULT/AC 0,20	1,88
EUROSPES, S.A.	ES0133421000	EUROSPES/AC 0,601012	0,76
EURONA WIRELESS TELECOM, S.A.	ES0133443004	EURONA.WIRELESS/AC 1,00	2,81
EUSKALTEL, S.A.	ES0105075008	EUSKALTEL/AC 3,00	10,67
FACEPHI BIOMETRIA, S.A.	ES0105029005	FACE/AC 0,04	0,40
FAES FARMA, S.A.	ES0134950F36	FAE/AC 0,10	2,56
FERROVIAL, S.A.	ES0118900010	FER/AC 0,20	21,92
FERSA ENERGIAS RENOVABLES, S.A.	ES0136463017	FRS/AC 0,70	0,39
FIDERE PATRIMONIO SOCIMI, S.A.	ES0105071007	YFID/AC 1,00	21,31
FLUIDRA, S.A.	ES0137650018	FDR/AC 1,00	3,09
FOMENTO DE CONSTRUCCIONES Y CONTRATAS, S.A.	ES0122060314	FCC/AC 1,00	6,81
FUNESPAÑA, S.A.	ES0140441017	FUN/AC 0,30	7,20
GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA, S.A.	ES0143416115	GAM/AC 0,17	15,01
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0116870314	GAS/AC 1,00	19,45
GENERAL DE ALQUILER DE MAQUINARIA, S.A.	ES0141571119	GALQ/AC 0,10	0,26
GERDAU, S.A.	BRGGBRACNPR8	AC. GERDAU -PREF -	1,31
GIGAS HOSTING, S.A.	ES0105093001	GIGAS HOSTING/AC 0,02	3,21
GREENERGY RENOVABLES, S.A.	ES0105079000	GRE/AC 0,15	1,78
GRIFOLS, S.A.	ES0171996004	GRF/ACSVT B 0,10	30,92
GRIFOLS, S.A.	ES0171996012	GRF/AC A 0,50	41,94
GRÍÑO ECOLOGIC, S.A.	ES0143328005	GRÍÑO.ECOLOGIC/AC 0,02	1,65
GRUPO CATALANA OCCIDENTE, S.A.	ES0116920333	GCO/AC 0,30	29,29
GRUPO ELEKTRA, S.A. DE C.V.	MX01EL000003	AC. GRUPO ELEKTRA	19,08
GRUPO EMPRESARIAL SAN JOSE, S.A.	ES0180918015	GSJ/AC 0,03	0,90
GRUPO EZENTIS, S.A.	ES0172708234	EZE/AC 0,30	0,58
GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	MXP370711014	AC. BANORTE S/O	4,80
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS, S.A.	ES0105019006	HIS/AC 1,00	13,30
HOME MEAL REPLACEMENT, S.A.	ES0105049003	HOME MEAL/AC 0,13	2,14
IBERDROLA, S.A.	ES0144580Y14	IBE/AC 0,75	6,43
IBERPAPEL GESTION, S.A.	ES0147561015	IBG/AC 0,60	16,23
IMAGINARIUM, S.A.	ES0147791018	IMAGINARIUM/AC 0,03	0,73
INCLAM, S.A.	ES0105083002	INCLAM/AC 0,01	1,72
INDRA SISTEMAS, S.A.	ES0118594417	IDR/AC A 0,20	9,59
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL, S.A.	ES0148396007	ITX/AC 0,03	32,54
INMOBILIARIA COLONIAL, S.A.	ES0139140042	COL/AC 0,25	0,66
INMOBILIARIA DEL SUR, S.A.	ES0154653911	ISUR/AC 2,00	9,06
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP, S.A.	ES0177542018	IAG/AC 0,50	8,12
INVERFIATC, S.A.	ES0143419317	INVERFIATC/AC 1,00	0,35
INYPISA INFORMES Y PROYECTOS, S.A.	ES0152768612	INY/AC 0,137	0,18
LABORATORIO REIG JOFRE, S.A.	ES0165359029	RJF/AC 2,00	3,82
LABORATORIOS FARMACEUTICOS ROVI, S.A.	ES0157261019	ROVI/AC 0,06	14,12
LAR ESPAÑA REAL ESTATE SOCIMI, S.A.	ES0105015012	LRE/AC 2,00	9,39
LIBERBANK, S.A.	ES0168675009	LBK/AC 0,30	0,57
LIBERTAS 7, S.A.	ES0137998A12	LIBERTAS.7/AC 0,50	2,20
LINGOTES ESPECIALES, S.A.	ES0158480311	LGT/AC 1,00	8,91
LIWE ESPAÑOLA, S.A.	ES0158545030	LIWE ESPAÑOLA/AC 3,15	11,50
LLEIDANETWORKS SERVEIS TELEMATICS, S.A.	ES0105089009	LLEIDANETWORKS/AC 0,02	1,06
MAPFRE, S.A.	ES0124244E34	MAP/AC 0,10	2,52
MASMOVIL IBERCOM, S.A.	ES0184696013	MAS/AC 0,10	22,33
MEDCOM TECH, S.A.	ES0161857018	MEDCOM.TECH/AC 0,01	6,30
MEDIASET ESPAÑA COMUNICACION, S.A.	ES0152503035	TL5/AC 0,50	10,46
MELIA HOTELS INTERNATIONAL, S.A.	ES0176252718	MEL/AC 0,20	12,32
MERLIN PROPERTIES, SOCIMI, S.A.	ES0105025003	MRL/AC 1,00	11,53
MIQUEL Y COSTAS & MIQUEL, S.A.	ES0164180012	MCM/AC 2,00	32,83
MONTEBALITO, S.A.	ES0116494016	MTB/AC 1,00	1,24
NATRA, S.A.	ES0165515117	NAT/AC 0,1332	0,37
NATURHOUSE HEALTH, S.A.	ES0105043006	NTH/AC 0,05	4,40
NBI BEARINGS EUROPE, S.A.	ES0105062022	NBI BEARINGS/AC 0,10	1,36
NEOL BIOSOLUTIONS, S.A.	ES0105081006	NEOL/AC 0,48	1,57
NEURON BIO, S.A.	ES0166198012	NEU/AC 1,00	1,68
NH HOTEL GROUP, S.A.	ES0161560018	NH/AC 2,00	5,18
NICOLAS CORREA, S.A.	ES0166300212	NEA/AC 0,80	1,25
NMAS DINAMIA, S.A.	ES0126501131	N1/AC 3,00	7,66
OBRASCON HUARTE LAIN, S.A.	ES0142090317	OHL/AC 0,60	7,14
OBSIDO SOCIMI, S.A.	ES0105074001	OBSIDO/AC 5,00	13,17
ONLY-APARTMENTS, S.A.	ES0105038006	ONL/AC 0,10	2,18
ORYZON GENOMICS, S.A.	ES0167733015	ORYZON.GENOMICS/AC 0,04	3,81
PAPELES Y CARTONES DE EUROPA, S.A.	ES0168561019	PAC/AC 2,00	5,00
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNOR9	AC. PETROBRAS	2,24
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNPR6	AC. PETROBRAS -PREF -	1,83
PHARMA MAR, S.A.	ES0169501030	PHARMA MAR/AC 0,05	3,39
PRIM, S.A.	ES0170884417	PRM/AC 0,25	8,98
PROMOCIONES RENTA Y MANTENIMIENTO, SOCIMI, S.A.	ES0171613005	PROMORENT/AC 2,00	1,06
PROMOTORA DE INFORMACIONES, S.A.	ES0171743901	PRS/AC 3,00	5,10

Nombre del Emisor	ISIN	Nombre del Valor	Valor Medio en Euros
PROSEGUR, CIA. DE SEGURIDAD, S.A.	ES0175438003	PSG/AC 0,06	4,19
QUABIT INMOBILIARIA, S.A.	ES0110944016	QBT/AC 0,01	0,07
REALIA BUSINESS, S.A.	ES0173908015	RLIA/AC 0,24	0,72
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0173093115	REE/AC 2,00	78,84
RENO DE MEDICI, S.P.A.	IT0001178299	AC. RENO DE MEDICI, S/A	0,35
RENTA 4 BANCO, S.A.	ES0173358039	R4/AC 0,45	5,84
RENTA CORPORACION REAL ESTATE, S.A.	ES0173365018	REN/AC 1,00	1,74
REPSOL, S.A.	ES0173516115	REP/AC 1,00	11,53
RONSA, S.A.	ES0174300014	RONSA/AC 60,10	49,50
SACYR, S.A.	ES0182870214	SYV/AC 1,00	2,20
SAETA YIELD, S.A.	ES0105058004	SAY/AC 1,00	8,70
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	10,22
SOLARIA ENERGIA Y MEDIO AMBIENTE, S.A.	ES0165386014	SLR/AC 0,01	0,78
SOTOGRADE, S.A.	ES0138109014	STG/AC 0,60	2,88
TALGO, S.A.	ES0105065009	TLGO/AC 0,301	5,68
TECNICAS REUNIDAS, S.A.	ES0178165017	TRE/AC 0,10	38,14
TECNOCOM, TELECOMUNICACIONES Y ENERGIA, S.A.	ES0147582B12	TEC/AC 0,50	1,23
TECNOQUARK TRUST, S.A.	ES0105076006	TECNOQUARK/AC 1,00	1,94
TELEFONICA, S.A.	ES0178430E18	TEF/AC 1,00	11,35
TESTA INMUEBLES EN RENTA, SOCIMI, S.A.	ES0170885018	TST/AC 0,20	13,38
THINK SMART, S.A.	ES0105097002	THK/AC 0,10	3,51
TRAJANO IBERIA, SOCIMI, S.A.	ES0105077004	TRAJANO IBERIA/AC 2,50	10,30
TUBACEX, S.A.	ES0132945017	TUB/AC 0,45	1,89
TUBOS REUNIDOS, S.A.	ES0180850416	TRG/AC 0,10	0,86
TV AZTECA, S.A. DE C.V.	MX01AZ060013	AC. TV AZTECA	0,16
UNION EUROPEA DE INVERSIONES, S.A.	ES0181480114	U.EUROPEA.INV/AC 1,00	1,66
URBAR INGENIEROS, S.A.	ES0182484214	URBAR.ING/AC 0,17	0,48
URBAS GRUPO FINANCIERO, S.A.	ES0182280018	URBAS/AC 0,01	0,01
URO PROPERTY HOLDINGS, SOCIMI, S.A.	ES0105059002	YURO/AC 2,00	55,94
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNOR3	AC. USIMINAS	1,72
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNPA6	AC. USIMINAS -PREF.-	0,61
VALE, S.A.	BRVALEACNOR0	AC. VALE	3,65
VALE, S.A.	BRVALEACNPA3	AC. VALE. PREF. 6%	2,98
VIDRALA, S.A.	ES0183746314	VID/AC 1,02	44,77
VISCOFAN, S.A.	ES0184262212	VIS/AC 0,70	55,41
VOCENTO, S.A.	ES0114820113	VOC/AC 0,20	1,61
VOLCAN COMPAÑIA MINERA, S.A.A.	PEP648014202	AC. VOLCAN. PREF. S/B	0,13
VOUSSE CORP, S.A.	ES0176406066	VOUSSE/AC 1,50	1,05
ZAMBAL SPAIN SOCIMI, S.A.	ES0105080008	ZAMBAL SPAIN/AC 1,00	1,30
ZARAGOZA PROPERTIES SOCIMI, S.A.	ES0105084000	ZARAGOZA PROP./AC 1,00	13,00
ZARDOYA OTIS, S.A.	ES0184933812	ZOT/AC 0,10	10,93
ZINKIA ENTERTAINMENT, S.A.	ES0184849018	ZNK/AC 0,10	0,83

(*) ANCV: Agencia Nacional de Codificación de Valores

(**) V: Cupón Variable, C: Cupón Cero