

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	ES0000101263	CC.AA.MAD/4,30 OB 20260915	15/09/2026	4,300	123,369
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101545	CC.AA.MAD/5,75 BO 20180201	01/02/2018	5,750	106,818
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101586	CC.AA.MAD/2,875 OB 20190406	06/04/2019	2,875	106,020
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101602	CC.AA.MAD/4,125 OB 20240521	21/05/2024	4,125	120,752
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101644	CC.AA.MAD/2,875 OB 20230717	17/07/2023	2,875	110,050
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101651	CC.AA.MAD/1,826 OB 20250430	30/04/2025	1,826	102,340
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101677	CC.AA.MAD/2,08 OB 20300312	12/03/2030	2,080	98,654
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101693	CC.AA.MAD/1,189 OB 20220508	08/05/2022	1,189	101,849
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101768	CC.AA.MAD/0,997 OB 20240930	30/09/2024	0,997	99,399
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000018688	ESTADO/6,00 OBSEGR 20290131	31/01/2029	6,000	151,022
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000018676	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20290131	31/01/2029	C	82,065
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000019198	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170131	31/01/2017	C	100,056
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES000001934	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	98,186
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012001	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20370131	31/01/2037	C	60,830
ESTADO ESPAÑOL - DIRECCION GENERAL DEL TESORO	ES0000012018	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	ES00000123N4	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	128,544
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 20181031 CAC	31/10/2018	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	115,354
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	ES00000127A3	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	ES00000958E3	GENCAT/4,69 OB 20341028	28/10/2034	4,690	83,951
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000958F9	GENCAT/4,22 OB 20350426	26/04/2035	4,220	87,384
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000959Z9	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 (**)	Valor 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	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/VAR 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	996,68
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790027	POP/8,25 OBSUBD 20211019	19/10/2021	8,250	996,87
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	2.824,72
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 III/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	V	7,26
EROSKI, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429038	EROSKI/VAR OBSUBD PERP	V	V	5,87
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 OBSUBDCONV 20180717 A	17/07/2018	5,000	2,36
LIBERBANK, S.A.	ES0268675016	LIBERBK/5,00 OBSUBDCONV 20180717 B	17/07/2018	5,000	2,45
LIBERBANK, S.A.	ES0268675024	LIBERBK/7,00 OBSUBDCONV 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 OBCONV 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/VAR 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/VAR 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/VAR 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.	ES03070148019	AYT.CED.CA.VI/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 I/VAR BTA 20191117 A	17/11/2019	V	9.271,58
AYT DEUDA SUBORDINADA I, F.T.A.	ES0312284013	AYT DEU SUBD I/VAR BTA 20191117 B	17/11/2019	V	57.645,23
AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, F.T.H.	ES03070150007	AYT GENOVA HIP I/VAR BTH 20360516 A	16/05/2036	V	20.904,18
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, F.T.H.	ES0312300017	AYT GEN HIP IX/VAR BTH 20390715 A2	15/07/2039	V	24.847,44
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, F.T.H.	ES0312343017	AYT GEN HIP VII/VAR BTH 20380915 A2	15/09/2038	V	19.695,83
AYT HIPOTECARIO IV, F.T.H.	ES0312370002	AYT HIP IV/VAR BTH 20330613 A GTIA	13/06/2033	V	5.847,20
AYT HIPOTECARIO MIXTO II, F.T.A.	ES03070151005	AYT.HIP.MIX.II/VAR BTA 20360620 PH1	20/06/2036	V	13.383,18
AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, F.T.A.	ES03070152003	AYT.HIP.MIX.IV/VAR BTA 20400120 A	20/01/2040	V	21.385,44
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, F.T.A.	ES03070154009	KUTXA.HIP.II/VAR BTA 20561015 A	15/10/2056	V	42.152,27
AYT.11, F.T.H.	ES0338541008	AYT.11/VAR BTH 20351015 A GTIA	15/10/2035	V	8.910,49
BANCAJA 10, F.T.A.	ES0312872015	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 A2 GTIA	22/05/2050	V	29.549,94
BANCAJA 10, F.T.A.	ES0312872023	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 A3 GTIA	22/05/2050	V	97.199,77
BANCAJA 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312885017	BANCAJA.6/VAR BTA 20360220 A2 GTIA	20/02/2036	V	12.661,24
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES031321110Q7	BBVA/VAR 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	996,85
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138602Q4	SAB/0,40 BO 20180920 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/VAR BOESTR 20211130 15	30/11/2021	V	100.000,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES03138602R7	SAB/VAR 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/VAR 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/VAR BTH 20480821 A2	21/08/2048	V	32.892,08
BANKINTER 3, F.T.H.	ES0314019003	BKT 3/VAR BTH 20381016 A GTIA	16/10/2038	V	7.742,33
BANKINTER 9, F.T.A.	ES0313814016	BKT.9/VAR 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/VAR BOESTR 20190916 92	16/09/2019	V	27.296,04
BANKINTER, S.A.	ES03136797R7	BKT/VAR BOESTR 20181005 115	05/10/2018	V	89.086,70
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067128	BBVA GM/VAR BOESTR 20180529 14	29/05/2018	V	96.949,48
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067292	BBVA GM/VAR BOESTR 20190803 39	03/08/2019	V	97.651,88
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067318	BBVA GM/VAR BOESTR 20171211 42	11/12/2017	V	24.301,80
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067391	BBVA GM/VAR 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	09/10/2017	0,500	100.000,00
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067490	BBVA GM/0,50 BOESTR 20171110 66	09/11/2017	0,500	100.000,00
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067516	BBVA GM/VAR BOESTR 20191118 68	18/11/2019	V	100.100,17
BBVA GLOBAL MARKETS B.V.	ES0305067532	BBVA GM/VAR 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/VAR BTA 20430128 A	28/01/2043	V	29.180,42
CAIXABANK, S.A.	ES03040609199	CABK/3,125 BO 20180514	14/05/2018	3,125	104.757,54
CAIXABANK, S.A.	ES03040609215	CABK/2,50 BO 20170418	18/04/2017	2,500	101.071,30
CAIXABANK, S.A.	ES03040609736	CABK/CUPCER BOESTR 20200619 I	19/06/2020	C	94.475,61
CAIXABANK, S.A.	ES03040609744	CABK/CUPCER BOESTR 20200731	31/07/2020	C	92.168,44
CAIXABANK, S.A.	ES03040609751	CABK/CUPCER BOESTR 20181023 I	23/10/2018	C	91.816,86
CAIXABANK, S.A.	ES03040609769	CABK/CUPCER BOESTR 20200205 I	05/02/2020	C	99.510,04
CAIXABANK, S.A.	ES03040609777	CABK/VAR 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 20200523 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	ES03050116008	DRIVER THREE/VAR BTA 20261221 A	21/12/2026	V	66.022,34
DRIVER ESPAÑA TWO, F.T.	ES0305094007	DRIVER TWO/VAR BTA 20260821 A GTIA	21/08/2026	V	54.316,95
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014104	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20190710 14	10/07/2019	V	1.007,04
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014179	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20171030 25	30/10/2017	V	958,40
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014237	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20171124 33	24/11/2017	V	955,82
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014369	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20200212 43	12/02/2020	V	993,05
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014377	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20180205 42	05/02/2018	V	996,14
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014393	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20200416 46	16/04/2020	V	997,36
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014401	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20190401 45	01/04/2019	V	926,43
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014419	EMISORA SAN/VAR BOESTR 20180514 47	14/05/2018	V	959,95
EMISORA SANTANDER ESPAÑA, S.A.U.	ES0305014427	EMISORA SAN/VAR 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	995,98
F.T.A. PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZACION DE CEDULAS HIPOTECARIAS	ES0334699008	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	81.749,57
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 9 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	110.276,09
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.	ES0347783005	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 20202021 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.	ES0347784003	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 BO 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/IVAR 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/IVAR 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/IVAR 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-MIXTO/VAR BTA 20360426 A2 GTIA	26/04/2036	V	12.234,22
TDA 20-MIXTO, F.T.A.	ES0377981032	TDA 20-MIXTO/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	26/02/2049	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	26/07/2035	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	100.800,74
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	102.446,65
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 20190525 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 20220328 GTIA	08/02/2023	1,000	105.097,82
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 2020126 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	103.075,67
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 20231018 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.	ES05406099A18	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.	ES0101339028	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	37.359,30
PASTOR PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.U.	ES0168569004	PASTOR.PREF/VAR 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	IKM/AC 0,10	2,17
AB-BIOTICS, S.A.	ES0109659013	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
ALTA CONSULTORES, S.A.	ES0113312005	ALTA 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	AMP/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
ATRYX HEALTH, S.A.	ES0105148003	ATRYX/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.	BRBBDACANPR8	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	BKTI/AC 0,30	7,02
BARON DE LEY, S.A.	ES0114297015	BDL/AC 0,60	105,65
BAYER A.G.	DE0008AY0017	AC, BAYER	91,84
BBVA BANCO FRANCES, S.A.	ARP125991090	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 ESPAÑOLES, 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.	ES01117390411	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	CBVA/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
COMMCENTER, S.A.	ES0121071007	COMMCENTER/AC 0,50	1,51
COMPANHIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	BRRCMIGACNPR3	AC, CEMIG -PREF.-	2,26
COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	BRCPLEACNPR9	AC, COPEL -PREF.-	8,19
COMPANIA DE DISTRIBUCION INTEGRAL LOGISTA HOLDINGS, S.A.	ES0105027009	LOG/AC 0,20	20,58
COMPANIA 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.	ES0126260047	MDF/AC 0,50	1,12
EBIOS ENERGY, A.D.	BG1100025128	EBIOS 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.	LU1048382220	EDREAMS/AC 0,10	2,86
ELECNOR, S.A.	ES0129743318	ENO/AC 0,10	8,90
ENAGAS, S.A.	ES0130960018	ENGI/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
FACEPH 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	GAMI/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
GRUPO ECOLOGIC, S.A.	ES0143328005	GRUPO ECOLOGIC/AC 0,02	1,28
GRUPO CATALANA OCCIDENTE, S.A.	ES0116920333	GCO/AC 0,30	29,68
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.	MXF370711014	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.	ES0144580Y14	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
INYPISA 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	ROV/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.	ES0105089000	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.	ES0164180012	MCMI/AC 2,00	27,87
MONDO TV IBEROAMÉRICA, S.A.	ES0105216008	MONDO TV IBAMI/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.	ES0168661019	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	1,83
QUONIA SOCIMI, S.A.	ES0105150009	QUONIA/AC 1,00	1,66
REALIA BUSINESS, S.A.	ES0173908015	RLI/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.	ES0147582812	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.	ES0184833812	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