



# **Estadísticas sobre la información económica y financiera de los Fondos de titulización de activos**

**Segundo semestre de 2012**



---

## INDICE

---

### INFORMACIÓN AGREGADA

- A BALANCE AGREGADO
  - B CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS AGREGADA
  - C ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO AGREGADO
  - D PRINCIPALES RATIOS / MAGNITUDES AGREGADAS
  - E INFORMACIÓN AGREGADA DE LOS ACTIVOS TITULIZADOS
- 

### INFORMACIÓN POR FONDO

#### 00 FONDOS DE TITULIZACIÓN

---

#### A.1 PRINCIPALES MAGNITUDES DE BALANCE FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS

##### A.1.1 IMPORTE PENDIENTE DERECHOS DE CRÉDITO FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS

- A.1.1a INFORMACIÓN DERECHOS DE CRÉDITO FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS - BONOS: HIPOTECARIOS
- A.1.1b INFORMACIÓN DERECHOS DE CRÉDITO FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS - BONOS: EMPRESAS
- A.1.1c INFORMACIÓN DERECHOS DE CRÉDITO FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS - BONOS: DEUDA SUBORDINADA Y BONOS DE TESORERÍA
- A.1.1d INFORMACIÓN DERECHOS DE CRÉDITO FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS - BONOS: ADMINISTRACIONES PÚBLICAS
- A.1.1e INFORMACIÓN DERECHOS DE CRÉDITO FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS - BONOS: CONSUMO Y AUTOMOCIÓN
- A.1.1f INFORMACIÓN DERECHOS DE CRÉDITO FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS - BONOS: CUENTAS A COBRAR
- A.1.1g INFORMACIÓN DERECHOS DE CRÉDITO FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS - BONOS: DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS
- A.1.1h INFORMACIÓN DERECHOS DE CRÉDITO FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS - BONOS: BONOS DE TITULIZACIÓN
- A.1.1i INFORMACIÓN DERECHOS DE CRÉDITO FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS - BONOS: OTROS
- A.1.1j INFORMACIÓN DERECHOS DE CRÉDITO FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS - PAGARÉS

##### A.1.2 INFORMACIÓN OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS

#### A.2 PRINCIPALES MAGNITUDES DE BALANCE FONDOS DE TITULIZACIÓN PRIVADOS

- A.2.1 IMPORTE PENDIENTE DERECHOS DE CRÉDITO FONDOS DE TITULIZACIÓN PRIVADOS
  - A.2.2 INFORMACIÓN DERECHOS DE CRÉDITO FONDOS DE TITULIZACIÓN PRIVADOS
  - A.2.3 INFORMACIÓN OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES FONDOS DE TITULIZACIÓN PRIVADOS
- 

#### B.1 PRINCIPALES MAGNITUDES DE RESULTADOS EN EL SEMESTRE - FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS

- B.1.1 MARGEN DE INTERESES FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS
- B.1.2 COMISIONES FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS

#### B.2 PRINCIPALES MAGNITUDES DE RESULTADOS EN EL SEMESTRE - FONDOS DE TITULIZACIÓN PRIVADOS

- B.2.1 MARGEN DE INTERESES FONDOS DE TITULIZACIÓN PRIVADOS
  - B.2.2 COMISIONES FONDOS DE TITULIZACIÓN PRIVADOS
- 

#### C.1 PRINCIPALES FLUJOS DE EFECTIVO EN EL SEMESTRE - FONDOS DE TITULIZACIÓN PÚBLICOS

#### C.2 PRINCIPALES FLUJOS DE EFECTIVO - FONDOS DE TITULIZACIÓN PRIVADOS

---

| Miles de euros   | 2012-2                |                         |                      |                  |                    | 2011-2                |                         |                      |                  |                    | % VARIACIÓN<br>TOTAL FONDOS |
|--|-----------------------|-------------------------|----------------------|------------------|--------------------|-----------------------|-------------------------|----------------------|------------------|--------------------|-----------------------------|
|  | BONOS/<br>F. PÚBLICOS | PAGARÉS/<br>F. PÚBLICOS | TOTAL<br>F. PÚBLICOS | F. PRIVADOS      | TOTAL<br>FONDOS    | BONOS/<br>F. PÚBLICOS | PAGARÉS/<br>F. PÚBLICOS | TOTAL<br>F. PÚBLICOS | F. PRIVADOS      | TOTAL<br>FONDOS    |                             |
| <b>ACTIVO</b>  |                       |                         |                      |                  |                    |                       |                         |                      |                  |                    |                             |
| <b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>                          | <b>265.654.645</b>    | <b>0</b>                | <b>265.654.645</b>   | <b>2.166.463</b> | <b>267.821.108</b> | <b>347.834.359</b>    | <b>0</b>                | <b>347.834.359</b>   | <b>2.156.347</b> | <b>349.990.706</b> | <b>-23,48</b>               |
| I. Activos financieros a largo plazo                   | 265.654.645           | 0                       | 265.654.645          | 2.166.463        | 267.821.108        | 347.834.359           | 0                       | 347.834.359          | 2.156.347        | 349.990.706        | -23,48                      |
| 1. Valores representativos de deuda                    | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 1.1 Bancos centrales                                   | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 1.2 Administraciones Públicas españolas                | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 1.3 Entidades de crédito                               | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 1.4 Otros sectores residentes                          | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 1.5 Administraciones Públicas no residentes            | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 1.6 Otros sectores no residentes                       | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 1.7 Activos dudosos                                    | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 1.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-) | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 1.9 Intereses y gastos devengados                      | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 1.10 Ajustes por operaciones de cobertura              | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2. Derechos de crédito                                 | 264.783.765           | 0                       | 264.783.765          | 2.166.463        | 266.950.228        | 346.643.103           | 0                       | 346.643.103          | 2.156.347        | 348.799.450        | -23,47                      |
| 2.1 Participaciones hipotecarias                       | 34.381.356            | 0                       | 34.381.356           | 0                | 34.381.356         | 40.813.939            | 0                       | 40.813.939           | 0                | 40.813.939         | -15,76                      |
| 2.2 Certificados de transmisión hipotecaria            | 75.918.984            | 0                       | 75.918.984           | 0                | 75.918.984         | 101.209.824           | 0                       | 101.209.824          | 219.369          | 101.429.193        | -25,15                      |
| 2.3 Préstamos hipotecarios                             | 418.186               | 0                       | 418.186              | 0                | 418.186            | 9.787.721             | 0                       | 9.787.721            | 0                | 9.787.721          | -95,73                      |
| 2.4 Cédulas Hipotecarias                               | 91.608.932            | 0                       | 91.608.932           | 997.000          | 92.605.932         | 112.739.891           | 0                       | 112.739.891          | 997.000          | 113.736.891        | -18,58                      |
| 2.5 Préstamos a promotores                             | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.6 Préstamos a PYMES                                  | 14.588.826            | 0                       | 14.588.826           | 554.747          | 15.143.573         | 19.222.245            | 0                       | 19.222.245           | 0                | 19.222.245         | -21,22                      |
| 2.7 Préstamos a empresas                               | 12.587.950            | 0                       | 12.587.950           | 302.637          | 12.890.587         | 23.511.780            | 0                       | 23.511.780           | 492.093          | 24.003.873         | -46,30                      |
| 2.8 Préstamos Corporativos                             | 1.972.836             | 0                       | 1.972.836            | 0                | 1.972.836          | 2.939.679             | 0                       | 2.939.679            | 0                | 2.939.679          | -32,89                      |
| 2.9 Cédulas territoriales                              | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.10 Bonos de Tesorería                                | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 550.000               | 0                       | 550.000              | 0                | 550.000            | -100,00                     |
| 2.11 Deuda Subordinada                                 | 299.379               | 0                       | 299.379              | 0                | 299.379            | 299.379               | 0                       | 299.379              | 0                | 299.379            | -                           |
| 2.12 Créditos AAPP                                     | 264.101               | 0                       | 264.101              | 118.516          | 382.617            | 366.656               | 0                       | 366.656              | 128.392          | 495.048            | -22,71                      |
| 2.13 Préstamos Consumo                                 | 2.848.902             | 0                       | 2.848.902            | 0                | 2.848.902          | 4.548.591             | 0                       | 4.548.591            | 0                | 4.548.591          | -37,37                      |
| 2.14 Préstamos automoción                              | 2.462.039             | 0                       | 2.462.039            | 31.923           | 2.493.962          | 2.896.092             | 0                       | 2.896.092            | 57.658           | 2.953.750          | -15,57                      |
| 2.15 Cuotas de Arrendamiento financiero (leasing)      | 1.969.636             | 0                       | 1.969.636            | 0                | 1.969.636          | 2.813.706             | 0                       | 2.813.706            | 10.804           | 2.824.510          | -30,27                      |
| 2.16 Cuentas a cobrar                                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.17 Derechos de crédito futuros                       | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.18 Bonos de titulación                               | 0                     | 0                       | 0                    | 44.236           | 44.236             | 0                     | 0                       | 0                    | 60.981           | 60.981             | -27,46                      |
| 2.19 Otros   | 19.413.853            | 0                       | 19.413.853           | 70.090           | 19.483.943         | 19.632.880            | 0                       | 19.632.880           | 108.639          | 19.741.519         | -1,30                       |
| 2.20 Activos dudosos                                   | 7.210.522             | 0                       | 7.210.522            | 133.754          | 7.344.276          | 6.336.696             | 0                       | 6.336.696            | 147.569          | 6.484.265          | 13,26                       |
| 2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos    | -1.161.737            | 0                       | -1.161.737           | -86.440          | -1.248.177         | -1.025.976            | 0                       | -1.025.976           | -66.158          | -1.092.134         | 14,29                       |
| 2.22 Intereses y gastos devengados                     | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.23 Ajustes por operaciones de cobertura              | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 3. Derivados   | 584.393               | 0                       | 584.393              | 0                | 584.393            | 876.363               | 0                       | 876.363              | 0                | 876.363            | -33,32                      |
| 3.1 Derivados de cobertura                             | 584.393               | 0                       | 584.393              | 0                | 584.393            | 876.363               | 0                       | 876.363              | 0                | 876.363            | -33,32                      |
| 3.2 Derivados de negociación                           | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 4. Otros activos financieros                           | 286.487               | 0                       | 286.487              | 0                | 286.487            | 314.893               | 0                       | 314.893              | 0                | 314.893            | -9,02                       |
| 4.1 Garantías financieras                              | 2.041                 | 0                       | 2.041                | 0                | 2.041              | 2.518                 | 0                       | 2.518                | 0                | 2.518              | -18,94                      |
| 4.2 Otros  | 284.446               | 0                       | 284.446              | 0                | 284.446            | 312.375               | 0                       | 312.375              | 0                | 312.375            | -8,94                       |
| II. Activos por impuesto diferido                      | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| III. Otros activos no corrientes                       | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |

| Miles de euros  | 2012-2                |                         |                      |                  |                    | 2011-2                |                         |                      |                  |                    | % VARIACIÓN<br>TOTAL FONDOS |
|---|-----------------------|-------------------------|----------------------|------------------|--------------------|-----------------------|-------------------------|----------------------|------------------|--------------------|-----------------------------|
|   | BONOS/<br>F. PÚBLICOS | PAGARÉS/<br>F. PÚBLICOS | TOTAL<br>F. PÚBLICOS | F. PRIVADOS      | TOTAL<br>FONDOS    | BONOS/<br>F. PÚBLICOS | PAGARÉS/<br>F. PÚBLICOS | TOTAL<br>F. PÚBLICOS | F. PRIVADOS      | TOTAL<br>FONDOS    |                             |
| <b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>                              | <b>95.282.402</b>     | <b>1.607.792</b>        | <b>96.890.194</b>    | <b>1.645.862</b> | <b>98.536.056</b>  | <b>107.917.096</b>    | <b>1.691.473</b>        | <b>109.608.569</b>   | <b>1.499.450</b> | <b>111.108.019</b> | <b>-11,32</b>               |
| IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta      | 1.046.485             | 658                     | 1.047.143            | 0                | 1.047.143          | 1.051.083             | 0                       | 1.051.083            | 0                | 1.051.083          | -0,37                       |
| V. Activos financieros a corto plazo                    | 55.309.959            | 1.300.714               | 56.610.673           | 1.083.358        | 57.694.031         | 65.241.589            | 1.533.715               | 66.775.304           | 1.189.065        | 67.964.369         | -15,11                      |
| 1. Deudores y otras cuentas a cobrar                    | 952.091               | 0                       | 952.091              | 27.994           | 980.085            | 1.068.080             | 0                       | 1.068.080            | 33.894           | 1.101.974          | -11,06                      |
| 2. Valores representativos de deuda                     | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.1 Bancos centrales                                    | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.2 Administraciones Públicas españolas                 | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.3 Entidades de crédito                                | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.4 Otros sectores residentes                           | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.5 Administraciones Públicas no residentes             | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.6 Otros sectores no residentes                        | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.7 Activos dudosos                                     | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.9 Intereses y gastos devengados                       | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.10 Ajustes por operaciones de cobertura               | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.11 Intereses vencidos e impagados                     | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 3. Derechos de crédito                                  | 54.261.674            | 1.300.714               | 55.562.388           | 1.055.343        | 56.617.731         | 64.022.153            | 1.533.715               | 65.555.868           | 1.154.993        | 66.710.861         | -15,13                      |
| 3.1 Participaciones hipotecarias                        | 3.521.793             | 0                       | 3.521.793            | 0                | 3.521.793          | 3.310.959             | 0                       | 3.310.959            | 0                | 3.310.959          | 6,37                        |
| 3.2 Certificados de transmisión hipotecaria             | 4.536.858             | 0                       | 4.536.858            | 217.212          | 4.754.070          | 6.844.045             | 0                       | 6.844.045            | 0                | 6.844.045          | -30,54                      |
| 3.3 Préstamos hipotecarios                              | 135.432               | 0                       | 135.432              | 0                | 135.432            | 547.276               | 0                       | 547.276              | 0                | 547.276            | -75,25                      |
| 3.4 Cédulas Hipotecarias                                | 16.776.757            | 0                       | 16.776.757           | 0                | 16.776.757         | 13.673.000            | 0                       | 13.673.000           | 0                | 13.673.000         | 22,70                       |
| 3.5 Préstamos a promotores                              | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 3.6 Prestamos a PYMES                                   | 7.119.720             | 0                       | 7.119.720            | 189.725          | 7.309.445          | 4.702.729             | 0                       | 4.702.729            | 0                | 4.702.729          | 55,43                       |
| 3.7 Préstamos a empresas                                | 6.662.774             | 0                       | 6.662.774            | 124.427          | 6.787.201          | 13.486.373            | 0                       | 13.486.373           | 222.740          | 13.709.113         | -50,49                      |
| 3.8 Prestamos Corporativos                              | 661.552               | 0                       | 661.552              | 0                | 661.552            | 1.019.663             | 0                       | 1.019.663            | 0                | 1.019.663          | -35,12                      |
| 3.9 Cédulas territoriales                               | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 1.630.000             | 0                       | 1.630.000            | 0                | 1.630.000          | -100,00                     |
| 3.10 Bonos de Tesorería                                 | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 2.559.000             | 0                       | 2.559.000            | 0                | 2.559.000          | -100,00                     |
| 3.11 Deuda Subordinada                                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 3.12 Créditos AAPP                                      | 109.421               | 0                       | 109.421              | 9.876            | 119.297            | 124.813               | 0                       | 124.813              | 9.876            | 134.689            | -11,43                      |
| 3.13 Préstamos Consumo                                  | 2.131.274             | 0                       | 2.131.274            | 0                | 2.131.274          | 2.483.634             | 0                       | 2.483.634            | 0                | 2.483.634          | -14,19                      |
| 3.14 Préstamos automoción                               | 1.514.422             | 0                       | 1.514.422            | 21.121           | 1.535.543          | 1.616.474             | 0                       | 1.616.474            | 346.435          | 1.962.909          | -21,77                      |
| 3.15 Arrendamiento financiero                           | 676.216               | 0                       | 676.216              | 31.150           | 707.366            | 981.776               | 0                       | 981.776              | 66.703           | 1.048.479          | -32,53                      |
| 3.16 Cuentas a cobrar                                   | 0                     | 1.288.284               | 1.288.284            | 325.466          | 1.613.750          | 0                     | 1.507.904               | 1.507.904            | 316.667          | 1.824.571          | -11,55                      |
| 3.17 Derechos de crédito futuros                        | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 10.746           | 10.746             | -100,00                     |
| 3.18 Bonos de titulación                                | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 3.19 Otros  | 6.270.510             | 0                       | 6.270.510            | 50.098           | 6.320.608          | 7.009.709             | 0                       | 7.009.709            | 47.995           | 7.057.704          | -10,44                      |
| 3.20 Activos dudosos                                    | 3.757.710             | 12.430                  | 3.770.140            | 150.994          | 3.921.134          | 2.864.967             | 8.722                   | 2.873.689            | 166.569          | 3.040.258          | 28,97                       |
| 3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-) | -1.947.802            | 0                       | -1.947.802           | -91.389          | -2.039.191         | -1.721.096            | 0                       | -1.721.096           | -57.314          | -1.778.410         | 14,66                       |
| 3.22 Intereses y gastos devengados                      | 2.257.559             | 0                       | 2.257.559            | 23.366           | 2.280.925          | 2.795.897             | 1.309                   | 2.797.206            | 22.705           | 2.819.911          | -19,11                      |
| 3.23 Ajustes por operaciones de cobertura               | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 3.24 Intereses vencidos e impagados                     | 77.478                | 0                       | 77.478               | 3.297            | 80.775             | 92.934                | 15.780                  | 108.714              | 1.871            | 110.585            | -26,96                      |
| 4. Derivados  | 61.091                | 0                       | 61.091               | 0                | 61.091             | 111.207               | 0                       | 111.207              | 0                | 111.207            | -45,07                      |
| 4.1 Derivados de cobertura                              | 61.091                | 0                       | 61.091               | 0                | 61.091             | 111.207               | 0                       | 111.207              | 0                | 111.207            | -45,07                      |
| 4.2 Derivados de negociación                            | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 5. Otros activos financieros                            | 35.103                | 0                       | 35.103               | 21               | 35.124             | 40.149                | 0                       | 40.149               | 178              | 40.327             | -12,90                      |
| 5.1 Garantías financieras                               | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 5.2 Otros   | 35.103                | 0                       | 35.103               | 21               | 35.124             | 40.149                | 0                       | 40.149               | 178              | 40.327             | -12,90                      |
| VI. Ajustes por periodificaciones                       | 82.496                | 13.983                  | 96.479               | 61               | 96.540             | 109.114               | 25.708                  | 134.822              | 141              | 134.963            | -28,47                      |
| 1. Comisiones   | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2. Otros  | 82.496                | 13.983                  | 96.479               | 61               | 96.540             | 109.114               | 25.708                  | 134.822              | 141              | 134.963            | -28,47                      |
| VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes     | 38.843.462            | 292.437                 | 39.135.899           | 562.443          | 39.698.342         | 41.515.310            | 132.050                 | 41.647.360           | 310.244          | 41.957.604         | -5,38                       |
| 1. Tesorería  | 38.834.496            | 292.437                 | 39.126.933           | 562.443          | 39.689.376         | 41.305.323            | 132.050                 | 41.437.373           | 310.244          | 41.747.617         | -4,93                       |
| 2. Otros activos líquidos equivalentes                  | 8.966                 | 0                       | 8.966                | 0                | 8.966              | 209.987               | 0                       | 209.987              | 0                | 209.987            | -95,73                      |
| <b>TOTAL ACTIVO</b>                                     | <b>360.937.047</b>    | <b>1.607.792</b>        | <b>362.544.839</b>   | <b>3.812.325</b> | <b>366.357.164</b> | <b>455.751.455</b>    | <b>1.691.473</b>        | <b>457.442.928</b>   | <b>3.655.797</b> | <b>461.098.725</b> | <b>-20,55</b>               |

| Miles de euros  | 2012-2                |                         |                      |                  |                    | 2011-2                |                         |                      |                  |                    | % VARIACIÓN<br>TOTAL FONDOS |
|---|-----------------------|-------------------------|----------------------|------------------|--------------------|-----------------------|-------------------------|----------------------|------------------|--------------------|-----------------------------|
|   | BONOS/<br>F. PÚBLICOS | PAGARÉS/<br>F. PÚBLICOS | TOTAL<br>F. PÚBLICOS | F. PRIVADOS      | TOTAL<br>FONDOS    | BONOS/<br>F. PÚBLICOS | PAGARÉS/<br>F. PÚBLICOS | TOTAL<br>F. PÚBLICOS | F. PRIVADOS      | TOTAL<br>FONDOS    |                             |
| <b>PASIVO</b>   |                       |                         |                      |                  |                    |                       |                         |                      |                  |                    |                             |
| <b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>                             | <b>303.401.562</b>    | <b>0</b>                | <b>303.401.562</b>   | <b>2.817.280</b> | <b>306.218.842</b> | <b>388.934.584</b>    | <b>0</b>                | <b>388.934.584</b>   | <b>2.710.581</b> | <b>391.645.165</b> | <b>-21,81</b>               |
| I. Provisiones a largo plazo                              | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| II. Pasivos financieros a largo plazo                     | 303.401.562           | 0                       | 303.401.562          | 2.817.280        | 306.218.842        | 388.934.584           | 0                       | 388.934.584          | 2.710.581        | 391.645.165        | -21,81                      |
| 1. Obligaciones y otros valores negociables               | 267.130.514           | 0                       | 267.130.514          | 2.570.455        | 269.700.969        | 348.829.451           | 0                       | 348.829.451          | 2.534.579        | 351.364.030        | -23,24                      |
| 1.1 Series no subordinadas                                | 219.251.140           | 0                       | 219.251.140          | 2.142.527        | 221.393.667        | 286.729.426           | 0                       | 286.729.426          | 2.453.428        | 289.182.854        | -23,44                      |
| 1.2 Series subordinadas                                   | 49.328.073            | 0                       | 49.328.073           | 448.985          | 49.777.058         | 63.040.256            | 0                       | 63.040.256           | 133.772          | 63.174.028         | -21,21                      |
| 1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | -1.444.866            | 0                       | -1.444.866           | -21.057          | -1.465.923         | -935.307              | 0                       | -935.307             | -52.621          | -987.928           | 48,38                       |
| 1.4 Intereses y gastos devengados                         | -3.833                | 0                       | -3.833               | 0                | -3.833             | -4.924                | 0                       | -4.924               | 0                | -4.924             | -22,16                      |
| 1.5 Ajustes por operaciones de cobertura                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2. Deudas con entidades de crédito                        | 32.497.872            | 0                       | 32.497.872           | 220.166          | 32.718.038         | 35.358.139            | 0                       | 35.358.139           | 138.995          | 35.497.134         | -7,83                       |
| 2.1 Prestamo subordinado                                  | 22.602.417            | 0                       | 22.602.417           | 276.804          | 22.879.221         | 25.813.579            | 0                       | 25.813.579           | 147.373          | 25.960.952         | -11,87                      |
| 2.2 Credito línea de liquidez                             | 7.911.872             | 0                       | 7.911.872            | 15.012           | 7.926.884          | 6.687.018             | 0                       | 6.687.018            | 9.720            | 6.696.738          | 18,37                       |
| 2.3 Otras deudas con entidades de crédito                 | 3.111.021             | 0                       | 3.111.021            | 0                | 3.111.021          | 3.800.584             | 0                       | 3.800.584            | 0                | 3.800.584          | -18,14                      |
| 2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | -1.127.438            | 0                       | -1.127.438           | -71.650          | -1.199.088         | -943.073              | 0                       | -943.073             | -18.098          | -961.171           | 24,75                       |
| 2.5 Intereses y gastos devengados                         | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 31                    | 0                       | 31                   | 0                | 31                 | -100,00                     |
| 2.6 Ajustes por operaciones de cobertura                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 3. Derivados  | 3.014.557             | 0                       | 3.014.557            | 26.659           | 3.041.216          | 4.169.221             | 0                       | 4.169.221            | 37.007           | 4.206.228          | -27,70                      |
| 3.1 Derivados de cobertura                                | 3.014.557             | 0                       | 3.014.557            | 26.659           | 3.041.216          | 4.169.221             | 0                       | 4.169.221            | 36.917           | 4.206.138          | -27,70                      |
| 3.2 Derivados de negociación                              | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 90               | 90                 | -100,00                     |
| 3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 4. Otros pasivos financieros                              | 758.619               | 0                       | 758.619              | 0                | 758.619            | 577.773               | 0                       | 577.773              | 0                | 577.773            | 31,30                       |
| 4.1 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 4.2 Otros   | 758.619               | 0                       | 758.619              | 0                | 758.619            | 577.773               | 0                       | 577.773              | 0                | 577.773            | 31,30                       |
| III. Pasivos por impuesto diferido                        | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |

| Miles de euros   | 2012-2                |                         |                      |                  |                    | 2011-2                |                         |                      |                  |                    | % VARIACIÓN<br>TOTAL FONDOS |
|--|-----------------------|-------------------------|----------------------|------------------|--------------------|-----------------------|-------------------------|----------------------|------------------|--------------------|-----------------------------|
|  | BONOS/<br>F. PÚBLICOS | PAGARÉS/<br>F. PÚBLICOS | TOTAL<br>F. PÚBLICOS | F. PRIVADOS      | TOTAL<br>FONDOS    | BONOS/<br>F. PÚBLICOS | PAGARÉS/<br>F. PÚBLICOS | TOTAL<br>F. PÚBLICOS | F. PRIVADOS      | TOTAL<br>FONDOS    |                             |
| <b>B) PASIVO CORRIENTE</b>   | <b>60.366.540</b>     | <b>1.607.792</b>        | <b>61.974.332</b>    | <b>1.023.858</b> | <b>62.998.190</b>  | <b>70.640.307</b>     | <b>1.691.473</b>        | <b>72.331.780</b>    | <b>983.637</b>   | <b>73.315.417</b>  | <b>-14,07</b>               |
| IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  | 6                     | 0                       | 6                    | 0                | 6                  | 10                    | 0                       | 10                   | 0                | 10                 | -40,00                      |
| V. Provisiones a corto plazo   | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| VI. Pasivos financieros a corto plazo                                      | 58.926.181            | 1.579.845               | 60.506.026           | 1.020.248        | 61.526.274         | 69.334.577            | 1.671.936               | 71.006.513           | 981.440          | 71.987.953         | -14,53                      |
| 1. Acreedores y otras cuentas a pagar                                      | 601.239               | 2.153                   | 603.392              | 105.969          | 709.361            | 299.424               | 0                       | 299.424              | 136.429          | 435.853            | 62,75                       |
| 2. Obligaciones y otros valores negociables                                | 54.047.255            | 1.349.085               | 55.396.340           | 892.264          | 56.288.604         | 66.646.241            | 1.595.680               | 68.241.921           | 828.643          | 69.070.564         | -18,51                      |
| 2.1 Series no subordinadas   | 48.888.474            | 1.340.000               | 50.228.474           | 857.944          | 51.086.418         | 59.473.940            | 1.581.934               | 61.055.874           | 799.383          | 61.855.257         | -17,41                      |
| 2.2 Series subordinadas  | 2.468.582             | 0                       | 2.468.582            | 31.300           | 2.499.882          | 4.169.468             | 0                       | 4.169.468            | 18.716           | 4.188.184          | -40,31                      |
| 2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                  | -96.937               | 0                       | -96.937              | -5.522           | -102.459           | -481.139              | 0                       | -481.139             | -1.749           | -482.888           | -78,78                      |
| 2.4 Intereses y gastos devengados  | 2.506.879             | 9.085                   | 2.515.964            | 8.055            | 2.524.019          | 3.203.810             | 13.746                  | 3.217.556            | 11.928           | 3.229.484          | -21,84                      |
| 2.5 Ajustes por operaciones de cobertura                                   | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 2.6 Intereses vencidos e impagados   | 280.257               | 0                       | 280.257              | 487              | 280.744            | 280.162               | 0                       | 280.162              | 365              | 280.527            | 0,08                        |
| 3. Deudas con entidades de crédito   | 3.045.172             | 228.607                 | 3.273.779            | 8.201            | 3.281.980          | 1.199.862             | 78.149                  | 1.278.011            | 2.070            | 1.280.081          | 156,39                      |
| 3.1 Prestamo subordinado   | 1.947.311             | 0                       | 1.947.311            | 11.793           | 1.959.104          | 819.327               | 0                       | 819.327              | 0                | 819.327            | 139,11                      |
| 3.2 Credito linea de liquidez  | 684.046               | 228.388                 | 912.434              | 0                | 912.434            | 78.989                | 78.049                  | 157.038              | 0                | 157.038            | 481,03                      |
| 3.3 Otras deudas con entidades de crédito                                  | 193.285               | 0                       | 193.285              | 0                | 193.285            | 64.844                | 0                       | 64.844               | 1.245            | 66.089             | 192,46                      |
| 3.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                  | -340.512              | 0                       | -340.512             | -7.552           | -348.064           | -254.546              | 0                       | -254.546             | -2.537           | -257.083           | 35,39                       |
| 3.5 Intereses y gastos devengados  | 59.693                | 219                     | 59.912               | 927              | 60.839             | 98.370                | 100                     | 98.470               | 3.362            | 101.832            | -40,26                      |
| 3.6 Ajustes por operaciones de cobertura                                   | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 3.7 Intereses vencidos e impagados   | 501.349               | 0                       | 501.349              | 3.033            | 504.382            | 392.878               | 0                       | 392.878              | 0                | 392.878            | 28,38                       |
| 4. Derivados   | 892.230               | 0                       | 892.230              | 13.781           | 906.011            | 1.052.708             | 0                       | 1.052.708            | 14.139           | 1.066.847          | -15,08                      |
| 4.1 Derivados de cobertura   | 892.230               | 0                       | 892.230              | 13.781           | 906.011            | 1.052.708             | 0                       | 1.052.708            | 14.115           | 1.066.823          | -15,07                      |
| 4.2 Derivados de negociación   | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 24               | 24                 | -100,00                     |
| 4.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| 5. Otros pasivos financieros   | 340.285               | 0                       | 340.285              | 33               | 340.318            | 136.342               | -1.893                  | 134.449              | 159              | 134.608            | 152,82                      |
| 5.1 Importe bruto  | 340.285               | 0                       | 340.285              | 33               | 340.318            | 136.342               | -1.893                  | 134.449              | 159              | 134.608            | 152,82                      |
| 5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| VII. Ajustes por periodificaciones   | 1.440.353             | 27.947                  | 1.468.300            | 3.610            | 1.471.910          | 1.305.720             | 19.537                  | 1.325.257            | 2.197            | 1.327.454          | 10,88                       |
| 1. Comisiones  | 1.338.469             | 27.947                  | 1.366.416            | 535              | 1.366.951          | 1.197.105             | 19.537                  | 1.216.642            | 2.061            | 1.218.703          | 12,16                       |
| 1.1 Comisión sociedad gestora  | 5.082                 | 13                      | 5.095                | 77               | 5.172              | 6.490                 | 16                      | 6.506                | 239              | 6.745              | -23,32                      |
| 1.2 Comisión administrador   | 17.793                | 1                       | 17.794               | 43               | 17.837             | 14.656                | 1                       | 14.657               | 141              | 14.798             | 20,54                       |
| 1.3 Comisión agente financiero/pagos                                       | 569                   | 0                       | 569                  | 7                | 576                | 829                   | 0                       | 829                  | 9                | 838                | -31,26                      |
| 1.4 Comisión variable - resultados realizados                              | 1.843.618             | 33.958                  | 1.877.576            | 644              | 1.878.220          | 1.776.861             | 27.928                  | 1.804.789            | 1.731            | 1.806.520          | 3,97                        |
| 1.5 Comisión variable - resultados no realizados                           | -1.540                | 0                       | -1.540               | 0                | -1.540             | 408                   | 0                       | 408                  | 0                | 408                | -477,45                     |
| 1.6 Otras comisiones del cedente   | -55                   | 0                       | -55                  | 0                | -55                | 11                    | 0                       | 11                   | 0                | 11                 | -600,00                     |
| 1.7 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                  | -527.429              | -6.025                  | -533.454             | -236             | -533.690           | -602.451              | -8.409                  | -610.860             | -67              | -610.927           | -12,64                      |
| 1.8 Otras comisiones   | 431                   | 0                       | 431                  | 0                | 431                | 301                   | 1                       | 302                  | 8                | 310                | 39,03                       |
| 2. Otros   | 101.884               | 0                       | 101.884              | 3.075            | 104.959            | 108.711               | 0                       | 108.711              | 136              | 108.847            | -3,57                       |
| <b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b> | <b>-2.831.055</b>     | <b>0</b>                | <b>-2.831.055</b>    | <b>-28.813</b>   | <b>-2.859.868</b>  | <b>-3.823.436</b>     | <b>0</b>                | <b>-3.823.436</b>    | <b>-38.421</b>   | <b>-3.861.857</b>  | <b>-25,95</b>               |
| VIII. Activos financieros disponibles para la venta                        | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | 0                     | 0                       | 0                    | 0                | 0                  | -                           |
| IX. Coberturas de flujos de efectivo                                       | -2.813.320            | 0                       | -2.813.320           | -28.868          | -2.842.188         | -3.794.449            | 0                       | -3.794.449           | -38.476          | -3.832.925         | -25,85                      |
| X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos                  | 0                     | 0                       | 0                    | 55               | 55                 | 0                     | 0                       | 0                    | 55               | 55                 | -                           |
| XI. Gastos de constitución en transición                                   | -17.735               | 0                       | -17.735              | 0                | -17.735            | -28.987               | 0                       | -28.987              | 0                | -28.987            | -38,82                      |
| <b>TOTAL PASIVO</b>  | <b>360.937.047</b>    | <b>1.607.792</b>        | <b>362.544.839</b>   | <b>3.812.325</b> | <b>366.357.164</b> | <b>455.751.455</b>    | <b>1.691.473</b>        | <b>457.442.928</b>   | <b>3.655.797</b> | <b>461.098.725</b> | <b>-20,55</b>               |

## Cuenta de pérdidas y ganancias agregada

## CUADRO B

| Miles de euros  | FONDOS PÚBLICOS/BONOS |                |             |                  |                  |              | FONDOS PÚBLICOS/PAGARÉS |               |              |               |               |              |
|---|-----------------------|----------------|-------------|------------------|------------------|--------------|-------------------------|---------------|--------------|---------------|---------------|--------------|
|   | PERIODO CORRIENTE     |                |             | ACUMULADO        |                  |              | PERIODO CORRIENTE       |               |              | ACUMULADO     |               |              |
|   | 2012-2                | 2011-2         | %           | 2012-2           | 2011-2           | %            | 2012-2                  | 2011-2        | %            | 2012-2        | 2011-2        | %            |
| 1. Intereses y rendimientos asimilados                                | 5.300.470             | 6.996.691      | -24,24      | 11.306.482       | 13.350.824       | -15,31       | 34.559                  | 41.183        | -16,08       | 79.509        | 76.467        | 3,98         |
| 1.1 Valores representativos de deuda                                  | 0                     | 0              | -           | 0                | 0                | -            | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| 1.2 Derechos de crédito   | 5.149.140             | 6.690.025      | -23,03      | 10.901.824       | 12.827.727       | -15,01       | 28.471                  | 35.510        | -19,82       | 68.522        | 66.201        | 3,51         |
| 1.3 Otros activos financieros   | 151.330               | 306.666        | -50,65      | 404.658          | 523.097          | -22,64       | 6.088                   | 5.673         | 7,32         | 10.987        | 10.266        | 7,02         |
| 2. Intereses y cargas asimilados                                      | -3.521.987            | -5.826.305     | -39,55      | -7.995.609       | -10.789.712      | -25,90       | -14.207                 | -23.344       | -39,14       | -30.844       | -49.647       | -37,87       |
| 2.1 Obligaciones y otros valores negociables                          | -3.281.715            | -5.412.528     | -39,37      | -7.418.138       | -10.066.604      | -26,31       | -10.834                 | -17.280       | -37,30       | -25.720       | -34.019       | -24,40       |
| 2.2 Deudas con entidades de crédito                                   | -212.699              | -376.290       | -43,47      | -522.745         | -653.344         | -19,99       | -3.373                  | -2.113        | 59,63        | -5.124        | -4.105        | 24,82        |
| 2.3 Otros pasivos financieros   | -27.573               | -37.487        | -26,45      | -54.726          | -69.764          | -21,56       | 0                       | -3.951        | -100,00      | 0             | -11.523       | -100,00      |
| 3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto) | -1.016.987            | -422.091       | 140,94      | -1.838.977       | -975.786         | 88,46        | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| <b>A) MARGEN DE INTERESES</b>   | <b>761.496</b>        | <b>748.295</b> | <b>1,76</b> | <b>1.471.896</b> | <b>1.585.326</b> | <b>-7,15</b> | <b>20.352</b>           | <b>17.839</b> | <b>14,09</b> | <b>48.665</b> | <b>26.820</b> | <b>81,45</b> |
| 4. Resultado de operaciones financieras (neto)                        | -1                    | -184           | -99,46      | -10              | -26              | -61,54       | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| 4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG         | 0                     | 0              | -           | 0                | 0                | -            | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| 4.2 Activos financieros disponibles para la venta                     | 0                     | -194           | -100,00     | 0                | 0                | -            | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| 4.3 Otros   | -1                    | 10             | -           | -10              | -26              | -61,54       | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| 5. Diferencias de cambio (neto)                                       | -15.607               | 35.454         | -           | -5.311           | 6.639            | -            | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| 6. Otros ingresos de explotación                                      | 4.911                 | 4.359          | 12,66       | 3.482            | 885              | 293,45       | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| 7. Otros gastos de explotación  | -459.723              | -495.019       | -7,13       | -958.882         | -1.053.518       | -8,98        | -22.801                 | -3.046        | 648,56       | -23.388       | -3.656        | 539,72       |
| 7.1 Servicios exteriores  | -52.952               | -59.012        | -10,27      | -105.040         | -122.875         | -14,51       | -66                     | -389          | -83,03       | -329          | -599          | -45,08       |
| 7.1.1 Servicios de profesionales independientes                       | -14.491               | -18.811        | -22,97      | -26.465          | -44.617          | -40,68       | -20                     | -24           | -16,67       | -42           | -48           | -12,50       |
| 7.1.2 Servicios bancarios y similares                                 | -35.300               | -36.198        | -2,48       | -71.935          | -71.503          | 0,60         | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| 7.1.3 Publicidad y propaganda   | -5                    | -5             | 0,00        | -64              | -8               | 700,00       | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| 7.1.4 Otros servicios   | -3.156                | -3.998         | -21,06      | -6.576           | -6.747           | -2,53        | -46                     | -365          | -87,40       | -287          | -551          | -47,91       |
| 7.2 Tributos  | 0                     | 0              | -           | 0                | 0                | -            | 0                       | -3            | -100,00      | 0             | 0             | -            |
| 7.3 Otros gastos de gestión corriente                                 | -406.771              | -436.007       | -6,71       | -853.842         | -930.643         | -8,25        | -22.735                 | -2.654        | 756,63       | -23.059       | -3.057        | 654,30       |
| 7.3.1 Comisión de sociedad gestora                                    | -19.006               | -23.015        | -17,42      | -38.448          | -45.952          | -16,33       | -216                    | -275          | -21,45       | -445          | -600          | -25,83       |
| 7.3.2 Comisión administrador  | -14.674               | -24.596        | -40,34      | -30.663          | -41.876          | -26,78       | -12                     | -14           | -14,29       | -24           | -27           | -11,11       |
| 7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos                            | -3.093                | -3.361         | -7,97       | -6.390           | -6.452           | -0,96        | 0                       | -2            | -100,00      | 0             | -5            | -100,00      |
| 7.3.4 Comisión variable - resultados realizados                       | -348.749              | -374.436       | -6,86       | -725.542         | -763.326         | -4,95        | -22.419                 | -2.277        | 884,58       | -22.419       | -2.277        | 884,58       |
| 7.3.5 Comisión variable - resultados no realizados                    | 1.045                 | 41.619         | -97,49      | 0                | 0                | -            | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| 7.3.6 Otras comisiones del cedente                                    | -1                    | -43            | -97,67      | -3               | -88              | -96,59       | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| 7.3.7 Otros gastos  | -22.293               | -52.175        | -57,27      | -52.796          | -72.949          | -27,63       | -88                     | -86           | 2,33         | -171          | -148          | 15,54        |
| 8. Deterioro de activos financieros (neto)                            | -763.760              | -749.581       | 1,89        | -1.352.238       | -1.394.281       | -3,02        | 48.026                  | -24.262       | -            | 39.346        | -32.049       | -            |
| 8.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda                | 0                     | 0              | -           | 0                | 0                | -            | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| 8.2 Deterioro neto de derechos de crédito                             | -763.760              | -746.325       | 2,34        | -1.352.238       | -1.394.281       | -3,02        | 48.026                  | -24.262       | -            | 39.346        | -32.049       | -            |
| 8.3 Deterioro neto de derivados                                       | 0                     | 0              | -           | 0                | 0                | -            | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| 8.4 Deterioro neto de otros activos financieros                       | 0                     | -3.256         | -100,00     | 0                | 0                | -            | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| 9. Dotaciones a provisiones (neto)                                    | -1.626                | -1.382         | 17,66       | -2.983           | -3.152           | -5,36        | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| 10. Ganancias (pérdidas) en activos no corrientes en venta            | -149.145              | -175.244       | -14,89      | -302.571         | -238.576         | 26,82        | -62.239                 | 0             | -            | -62.239       | 0             | -            |
| 11. Repercusión de pérdidas (ganancias)                               | 623.455               | 633.302        | -1,55       | 1.146.617        | 1.096.703        | 4,55         | 16.662                  | 9.469         | 75,96        | -2.384        | 8.885         | -            |
| <b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>                                | <b>0</b>              | <b>0</b>       | <b>-</b>    | <b>0</b>         | <b>0</b>         | <b>-</b>     | <b>0</b>                | <b>0</b>      | <b>-</b>     | <b>0</b>      | <b>0</b>      | <b>-</b>     |
| 12. Impuestos sobre beneficios  | 0                     | 0              | -           | 0                | 0                | -            | 0                       | 0             | -            | 0             | 0             | -            |
| <b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>                                       | <b>0</b>              | <b>0</b>       | <b>-</b>    | <b>0</b>         | <b>0</b>         | <b>-</b>     | <b>0</b>                | <b>0</b>      | <b>-</b>     | <b>0</b>      | <b>0</b>      | <b>-</b>     |



## Cuenta de pérdidas y ganancias agregada

CUADRO B

| Miles de euros  | FONDOS PRIVADOS   |              |               |               |              |               | TOTAL FONDOS      |                |             |                  |                  |              |
|---|-------------------|--------------|---------------|---------------|--------------|---------------|-------------------|----------------|-------------|------------------|------------------|--------------|
|   | PERIODO CORRIENTE |              |               | ACUMULADO     |              |               | PERIODO CORRIENTE |                |             | ACUMULADO        |                  |              |
|   | 2012-2            | 2011-2       | %             | 2012-2        | 2011-2       | %             | 2012-2            | 2011-2         | %           | 2012-2           | 2011-2           | %            |
| 1. Intereses y rendimientos asimilados                                | 54.043            | 70.269       | -23,09        | 114.518       | 128.653      | -10,99        | 5.389.072         | 7.108.143      | -24,18      | 11.500.509       | 13.555.944       | -15,16       |
| 1.1 Valores representativos de deuda                                  | 0                 | -236         | -100,00       | 0             | 0            | -             | 0                 | -236           | -100,00     | 0                | -                | -            |
| 1.2 Derechos de crédito   | 52.232            | 67.935       | -23,11        | 109.944       | 123.897      | -11,26        | 5.229.843         | 6.793.470      | -23,02      | 11.080.290       | 13.017.825       | -14,88       |
| 1.3 Otros activos financieros   | 1.811             | 2.570        | -29,53        | 4.574         | 4.756        | -3,83         | 159.229           | 314.909        | -49,44      | 420.219          | 538.119          | -21,91       |
| 2. Intereses y cargas asimilados                                      | -26.600           | -54.366      | -51,07        | -64.962       | -102.390     | -36,55        | -3.562.794        | -5.904.015     | -39,65      | -8.091.415       | -10.941.749      | -26,05       |
| 2.1 Obligaciones y otros valores negociables                          | -24.511           | -27.569      | -11,09        | -60.072       | -47.793      | 25,69         | -3.317.060        | -5.457.377     | -39,22      | -7.503.930       | -10.148.416      | -26,06       |
| 2.2 Deudas con entidades de crédito                                   | -2.089            | -26.797      | -92,20        | -4.890        | -54.597      | -91,04        | -218.161          | -405.200       | -46,16      | -532.759         | -712.046         | -25,18       |
| 2.3 Otros pasivos financieros   | 0                 | 0            | -             | 0             | 0            | -             | -27.573           | -41.438        | -33,46      | -54.726          | -81.287          | -32,68       |
| 3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto) | -7.148            | -11.977      | -40,32        | -13.983       | -20.557      | -31,98        | -1.024.135        | -434.068       | 135,94      | -1.852.960       | -996.343         | 85,98        |
| <b>A) MARGEN DE INTERESES</b>   | <b>20.295</b>     | <b>3.926</b> | <b>416,94</b> | <b>35.573</b> | <b>5.706</b> | <b>523,43</b> | <b>802.143</b>    | <b>770.060</b> | <b>4,17</b> | <b>1.556.134</b> | <b>1.617.852</b> | <b>-3,81</b> |
| 4. Resultado de operaciones financieras (neto)                        | 0                 | 1            | -100,00       | -1            | 0            | -             | -1                | -183           | -99,45      | -11              | -26              | -57,69       |
| 4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG         | 0                 | 0            | -             | 0             | 0            | -             | 0                 | -              | -           | 0                | -                | -            |
| 4.2 Activos financieros disponibles para la venta                     | 0                 | 0            | -             | 0             | 0            | -             | 0                 | -194           | -100,00     | 0                | -                | -            |
| 4.3 Otros   | 0                 | 1            | -100,00       | -1            | 0            | -             | -1                | 11             | -           | -11              | -26              | -57,69       |
| 5. Diferencias de cambio (neto)                                       | 211               | -212         | -             | 65            | -148         | -             | -15.396           | 35.242         | -           | -5.246           | 6.491            | -            |
| 6. Otros ingresos de explotación                                      | 16                | -1           | -             | 0             | 47           | -100,00       | 4.927             | 4.358          | 13,06       | 3.482            | 932              | 273,61       |
| 7. Otros gastos de explotación  | -3.150            | -3.365       | -6,39         | -7.262        | -4.307       | 68,61         | -485.674          | -501.430       | -3,14       | -989.532         | -1.061.481       | -6,78        |
| 7.1 Servicios exteriores  | -44               | -149         | -70,47        | -81           | -183         | -55,74        | -53.062           | -59.550        | -10,90      | -105.450         | -123.657         | -14,72       |
| 7.1.1 Servicios de profesionales independientes                       | -5                | -120         | -95,83        | -22           | -124         | -82,26        | -14.516           | -18.955        | -23,42      | -26.529          | -44.789          | -40,77       |
| 7.1.2 Servicios bancarios y similares                                 | -31               | -16          | 93,75         | -43           | -28          | 53,57         | -35.331           | -36.214        | -2,44       | -71.978          | -71.531          | 0,62         |
| 7.1.3 Publicidad y propaganda   | 0                 | 0            | -             | 0             | 0            | -             | -5                | -5             | -           | -64              | -8               | 700,00       |
| 7.1.4 Otros servicios   | -8                | -13          | -38,46        | -16           | -31          | -48,39        | -3.210            | -4.376         | -26,65      | -6.879           | -7.329           | -6,14        |
| 7.2 Tributos  | 0                 | 0            | -             | 0             | 0            | -             | 0                 | -3             | -100,00     | 0                | -                | -            |
| 7.3 Otros gastos de gestión corriente                                 | -3.106            | -3.216       | -3,42         | -7.181        | -4.124       | 74,13         | -432.612          | -441.877       | -2,10       | -884.082         | -937.824         | -5,73        |
| 7.3.1 Comisión de sociedad gestora                                    | -292              | -404         | -27,72        | -614          | -650         | -5,54         | -19.514           | -23.694        | -17,64      | -39.507          | -47.202          | -16,30       |
| 7.3.2 Comisión administrador  | -268              | -477         | -43,82        | -595          | -696         | -14,51        | -14.954           | -25.087        | -40,39      | -31.282          | -42.599          | -26,57       |
| 7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos                            | -83               | -41          | 102,44        | -145          | -82          | 76,83         | -3.176            | -3.404         | -6,70       | -6.535           | -6.539           | -0,06        |
| 7.3.4 Comisión variable - resultados realizados                       | -2.381            | -5.429       | -56,14        | -5.734        | -2.545       | 125,30        | -373.549          | -382.142       | -2,25       | -753.695         | -768.148         | -1,88        |
| 7.3.5 Comisión variable - resultados no realizados                    | 0                 | 3.203        | -100,00       | 0             | 0            | -             | 1.045             | 44.822         | -97,67      | 0                | -                | -            |
| 7.3.6 Otras comisiones del cedente                                    | 0                 | 0            | -             | 0             | 0            | -             | -1                | -43            | -97,67      | -3               | -88              | -96,59       |
| 7.3.7 Otros gastos  | -82               | -68          | 20,59         | -93           | -151         | -38,41        | -22.463           | -52.329        | -57,07      | -53.060          | -73.248          | -27,56       |
| 8. Deterioro de activos financieros (neto)                            | -66.332           | -10.885      | 509,39        | -83.871       | -8.333       | 906,49        | -782.066          | -784.728       | -0,34       | -1.396.763       | -1.434.663       | -2,64        |
| 8.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda                | 0                 | 0            | -             | 0             | 0            | -             | 0                 | -              | -           | 0                | -                | -            |
| 8.2 Deterioro neto de derechos de crédito                             | -66.332           | -10.885      | 509,39        | -83.871       | -8.333       | 906,49        | -782.066          | -781.472       | 0,08        | -1.396.763       | -1.434.663       | -2,64        |
| 8.3 Deterioro neto de derivados                                       | 0                 | 0            | -             | 0             | 0            | -             | 0                 | -              | -           | 0                | -                | -            |
| 8.4 Deterioro neto de otros activos financieros                       | 0                 | 0            | -             | 0             | 0            | -             | 0                 | -3.256         | -100,00     | 0                | -                | -            |
| 9. Dotaciones a provisiones (neto)                                    | 0                 | 0            | -             | 0             | 0            | -             | -1.626            | -1.382         | 17,66       | -2.983           | -3.152           | -5,36        |
| 10. Ganancias (pérdidas) en activos no corrientes en venta            | 0                 | 0            | -             | 0             | 0            | -             | -211.384          | -175.244       | 20,62       | -364.810         | -238.576         | 52,91        |
| 11. Repercusión de pérdidas (ganancias)                               | 48.960            | 10.536       | 364,69        | 55.496        | 7.035        | 688,86        | 689.077           | 653.307        | 5,48        | 1.199.729        | 1.112.623        | 7,83         |
| <b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>                                | <b>0</b>          | <b>0</b>     | <b>-</b>      | <b>0</b>      | <b>0</b>     | <b>-</b>      | <b>0</b>          | <b>0</b>       | <b>-</b>    | <b>0</b>         | <b>0</b>         | <b>-</b>     |
| 12. Impuestos sobre beneficios  | 0                 | 0            | -             | 0             | 0            | -             | 0                 | 0              | -           | 0                | 0                | -            |
| <b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>                                       | <b>0</b>          | <b>0</b>     | <b>-</b>      | <b>0</b>      | <b>0</b>     | <b>-</b>      | <b>0</b>          | <b>0</b>       | <b>-</b>    | <b>0</b>         | <b>0</b>         | <b>-</b>     |

## Estado de flujos de efectivo agregado

## CUADRO C

| Miles de euros   | FONDOS PÚBLICOS/BONOS |                   |               |                  |                   |               | FONDOS PÚBLICOS/PAGARÉS |                 |              |                |                 |               |
|--|-----------------------|-------------------|---------------|------------------|-------------------|---------------|-------------------------|-----------------|--------------|----------------|-----------------|---------------|
|  | PERIODO CORRIENTE     |                   |               | ACUMULADO        |                   |               | PERIODO CORRIENTE       |                 |              | ACUMULADO      |                 |               |
|  | 2012-2                | 2011-2            | %             | 2012-2           | 2011-2            | %             | 2012-2                  | 2011-2          | %            | 2012-2         | 2011-2          | %             |
| <b>A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN</b>                    | <b>395.376</b>        | <b>1.203.469</b>  | <b>-67,15</b> | <b>1.229.801</b> | <b>2.044.929</b>  | <b>-39,86</b> | <b>4.133</b>            | <b>4.299</b>    | <b>-3,86</b> | <b>6.733</b>   | <b>7.735</b>    | <b>-12,95</b> |
| 1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones                                     | 609.203               | 1.220.339         | -50,08        | 1.388.972        | 2.048.888         | -32,21        | 4.204                   | 4.139           | 1,57         | 7.126          | 8.023           | -11,18        |
| 1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados  | 4.090.574             | 5.712.756         | -28,40        | 10.923.342       | 12.499.739        | -12,61        | -462                    | -302            | 52,98        | 0              | 284             | -100,00       |
| 1.2 Intereses pagados por valores de titulización  | -2.472.521            | -4.134.091        | -40,19        | -7.741.140       | -9.531.515        | -18,78        | -                       | -371            | -100,00      | 0              | -641            | -100,00       |
| 1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados  | -1.022.375            | -339.567          | 201,08        | -1.764.196       | -872.821          | 102,13        | -                       | -               | -            | 0              | 0               | -             |
| 1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras  | 131.108               | 235.512           | -44,33        | 356.083          | 418.974           | -15,01        | 6.899                   | 17.904          | -61,47       | 11.099         | 22.472          | -50,61        |
| 1.5 Intereses pagados de préstamos y créditos en entidades de crédito                      | -117.889              | -254.188          | -53,62        | -385.346         | -465.351          | -17,19        | -3.265                  | -13.092         | -75,06       | -5.005         | -14.092         | -64,48        |
| 1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)  | 306                   | -83               | -             | 229              | -138              | -             | 1.032                   | -               | -            | 1.032          | 0               | -             |
| 2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo                      | -197.155              | -312.908          | -36,99        | -499.270         | -658.609          | -24,19        | -14                     | 8.469           | -            | -472           | -476            | -0,84         |
| 2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora   | -16.493               | -24.294           | -32,11        | -39.273          | -48.643           | -19,26        | -217                    | -124            | 75,00        | -448           | -437            | 2,52          |
| 2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados                           | -9.787                | -15.210           | -35,65        | -25.231          | -33.245           | -24,11        | -12                     | -15             | -20,00       | -24            | -27             | -11,11        |
| 2.3 Comisiones pagadas al agente financiero  | -2.903                | -3.259            | -10,92        | -6.423           | -6.353            | 1,10          | -                       | -5              | -100,00      | 0              | -5              | -100,00       |
| 2.4 Comisiones variables pagadas   | -129.882              | -227.884          | -43,01        | -351.312         | -461.596          | -23,89        | -                       | 8.198           | -100,00      | 0              | 0               | -             |
| 2.5 Otras comisiones   | -38.090               | -42.261           | -9,87         | -77.031          | -108.772          | -29,18        | 215                     | 415             | -48,19       | 0              | -7              | -100,00       |
| 3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo                              | -16.672               | 296.038           | -             | 340.099          | 654.650           | -48,05        | -57                     | -8.309          | -99,31       | 79             | 188             | -57,98        |
| 3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos                                  | -67.134               | 83.637            | -             | 63.980           | 226.821           | -71,79        | -136                    | -1.758          | -92,26       | 0              | 221             | -100,00       |
| 3.2 Pagos de provisiones   | -                     | -                 | -             | 0                | 0                 | -             | -                       | -               | -            | 0              | 0               | -             |
| 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta | 134700                | 34242             | 293,38        | 194628           | 58755             | 231,25        | 183                     | -               | -            | 183            | 0               | -             |
| 3.4 Otros  | -84.238               | 178.159           | -             | 81.491           | 369.074           | -77,92        | -104                    | -6.551          | -98,41       | -104           | -33             | 215,15        |
| <b>B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSIÓN/ FINANCIACIÓN</b>            | <b>-1.898.359</b>     | <b>9.605.736</b>  | <b>-</b>      | <b>1.894.161</b> | <b>11.073.470</b> | <b>-82,89</b> | <b>480.636</b>          | <b>-483.426</b> | <b>-</b>     | <b>157.353</b> | <b>-548.875</b> | <b>-</b>      |
| 4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización                             | 9.889.933             | 29.560.778        | -66,54        | 20.679.291       | 66.200.694        | -68,76        | 658.000                 | 895.053         | -26,48       | 1.875.000      | 2.336.084       | -19,74        |
| 4.1 Cobros por emisión de valores de titulización  | 9.893.036             | 29.562.328        | -66,53        | 20.684.346       | 66.215.156        | -68,76        | 658.000                 | 895.059         | -26,49       | 1.875.000      | 2.336.093       | -19,74        |
| 4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)                | -3.103                | -1.550            | 100,19        | -5.055           | -14.462           | -65,05        | -                       | -6              | -100,00      | 0              | -9              | -100,00       |
| 5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros                                   | -9.732.857            | -26.374.309       | -63,10        | -19.716.993      | -63.697.786       | -69,05        | -4.537.557              | -5.173.349      | -12,29       | -9.276.557     | -11.439.059     | -18,90        |
| 5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito   | -9.732.857            | -26.374.309       | -63,10        | -19.716.993      | -63.697.786       | -69,05        | -4.537.557              | -5.173.349      | -12,29       | -9.276.557     | -11.439.059     | -18,90        |
| 5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras                                 | -                     | -                 | -             | 0                | 0                 | -             | -                       | -               | -            | 0              | 0               | -             |
| 6. Flujos de caja netos por amortizaciones   | -2.829.315            | 1.395.849         | -             | -3.191.093       | -2.351.561        | 35,70         | 4.232.312               | 3.822.946       | 10,71        | 7.408.571      | 8.582.933       | -13,68        |
| 6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito   | 20.926.517            | 28.592.946        | -26,81        | 47.171.959       | 53.406.835        | -11,67        | 4.809.312               | 5.678.308       | -15,30       | 9.110.571      | 12.274.651      | -25,78        |
| 6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados                                   | -4.589                | 24.119            | -             | 0                | 24.900            | -100,00       | -                       | 63.911          | -100,00      | 0              | 221.285         | -100,00       |
| 6.3 Pagos por amortización de valores de titulización                                      | -23.751.243           | -27.221.216       | -12,75        | -50.363.052      | -55.783.296       | -9,72         | -577.000                | -1.919.273      | -69,94       | -1.702.000     | -3.913.003      | -56,50        |
| 7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo                                      | 773.880               | 5.023.418         | -84,59        | 4.122.956        | 10.922.123        | -62,25        | 127.881                 | -28.076         | -            | 150.339        | -28.833         | -             |
| 7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos                        | 780.597               | 7.924.077         | -90,15        | 3.987.274        | 13.883.971        | -71,28        | 127.881                 | -               | -            | 150.339        | 0               | -             |
| 7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos   | 13.612                | -2.736.155        | -             | -770.391         | -3.121.296        | -75,32        | -                       | -28.076         | -100,00      | 0              | -28.833         | -100,00       |
| 7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso  | 180.903               | 6.952             | 2.502,17      | 586.950          | 266.388           | 120,34        | -                       | -               | -            | 0              | 0               | -             |
| 7.4 Administraciones públicas - Pasivo   | -776                  | -827              | -6,17         | -2.596           | -2.400            | 8,17          | -                       | -               | -            | 0              | 0               | -             |
| 7.5 Otros deudores y acreedores  | -200.612              | -170.458          | 17,69         | 321.719          | -104.369          | -             | -                       | -               | -            | 0              | 0               | -             |
| 7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras                             | -                     | -                 | -             | 0                | 0                 | -             | -                       | -               | -            | 0              | 0               | -             |
| 7.7 Cobros de Subvenciones   | 156                   | -171              | -             | 0                | -171              | -100,00       | -                       | -               | -            | 0              | 0               | -             |
| <b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>                        | <b>-1.502.983</b>     | <b>10.809.205</b> | <b>-</b>      | <b>3.123.962</b> | <b>13.118.399</b> | <b>-76,19</b> | <b>484.769</b>          | <b>-479.127</b> | <b>-</b>     | <b>164.086</b> | <b>-541.140</b> | <b>-</b>      |
| Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo  | -                     | -                 | -             | 35.719.504       | 28.396.912        | 25,79         | -                       | -               | -            | 128.351        | 673.190         | -80,93        |
| Efectivo o equivalentes al final del periodo   | -                     | -                 | -             | 38.843.466       | 41.515.311        | -6,44         | -                       | -               | -            | 292.437        | 132.050         | 121,46        |

1 No incluye los Fondos Privados

## Estado de flujos de efectivo agregado

## CUADRO C

| Miles de euros   | FONDOS PRIVADOS |               |               | TOTAL FONDOS                   |                   |               |                  |                   |               |
|--|-----------------|---------------|---------------|--------------------------------|-------------------|---------------|------------------|-------------------|---------------|
|  | ACUMULADO       |               |               | PERIODO CORRIENTE <sup>1</sup> |                   |               | ACUMULADO        |                   |               |
|  | 2012-2          | 2011-2        | %             | 2012-2                         | 2011-2            | %             | 2012-2           | 2011-2            | %             |
| <b>A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN</b>                    | <b>14.869</b>   | <b>3.591</b>  | <b>314,06</b> | <b>399.509</b>                 | <b>1.207.768</b>  | <b>-66,92</b> | <b>1.251.403</b> | <b>2.056.255</b>  | <b>-39,14</b> |
| 1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones                                     | 28.510          | 19.942        | 42,96         | 613.407                        | 1.224.478         | -49,90        | 1.424.608        | 2.076.853         | -31,41        |
| 1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados  | 103.088         | 78.344        | 31,58         | 4.090.112                      | 5.712.454         | -28,40        | 11.026.430       | 12.578.367        | -12,34        |
| 1.2 Intereses pagados por valores de titulización  | -60.311         | -44.024       | 37,00         | -2.472.521                     | -4.134.462        | -40,20        | -7.801.451       | -9.576.180        | -18,53        |
| 1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados  | -14.941         | -16.812       | -11,13        | -1.022.375                     | -339.567          | 201,08        | -1.779.137       | -889.633          | 99,99         |
| 1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras  | 4.809           | 4.475         | 7,46          | 138.007                        | 253.416           | -45,54        | 371.991          | 445.921           | -16,58        |
| 1.5 Intereses pagados de préstamos y créditos en entidades de crédito                      | -4.135          | -2.041        | 102,60        | -121.154                       | -267.280          | -54,67        | -394.486         | -481.484          | -18,07        |
| 1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)  | 0               | 0             | -             | 1.338                          | -83               | -             | 1.261            | -138              | -             |
| 2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo                      | -13.564         | -2.887        | 369,83        | -197.169                       | -304.439          | -35,24        | -513.306         | -661.972          | -22,46        |
| 2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora   | -803            | -501          | 60,28         | -16.710                        | -24.418           | -31,57        | -40.524          | -49.581           | -18,27        |
| 2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados                           | -615            | -867          | -29,07        | -9.799                         | -15.225           | -35,64        | -25.870          | -34.139           | -24,22        |
| 2.3 Comisiones pagadas al agente financiero  | -128            | -52           | 146,15        | -2.903                         | -3.264            | -11,06        | -6.551           | -6.410            | 2,20          |
| 2.4 Comisiones variables pagadas   | -11.972         | -1.451        | 725,09        | -129.882                       | -219.686          | -40,88        | -363.284         | -463.047          | -21,54        |
| 2.5 Otras comisiones   | -46             | -16           | 187,50        | -37.875                        | -41.846           | -9,49         | -77.077          | -108.795          | -29,15        |
| 3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo                              | -77             | -13.464       | -99,43        | -16.729                        | 287.729           | -             | 340.101          | 641.374           | -46,97        |
| 3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos                                  | 0               | 0             | -             | -67.270                        | 81.879            | -             | 63.980           | 227.042           | -71,82        |
| 3.2 Pagos de provisiones   | 0               | 0             | -             | 0                              | -                 | -             | 0                | -                 | -             |
| 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta | 0               | 0             | -             | 134883                         | 34242             | 293,91        | 194.811          | 58755             | 231,56        |
| 3.4 Otros  | -77             | -13.464       | -99,43        | -84.342                        | 171.608           | -             | 81.310           | 355.577           | -77,13        |
| <b>B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSIÓN/ FINANCIACIÓN</b>            | <b>282.961</b>  | <b>57.997</b> | <b>387,89</b> | <b>-1.417.723</b>              | <b>9.122.310</b>  | <b>-</b>      | <b>2.334.475</b> | <b>10.582.592</b> | <b>-77,94</b> |
| 4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización                             | 2.690.231       | 2.560.729     | 5,06          | 10.547.933                     | 30.455.831        | -65,37        | 25.244.522       | 71.097.507        | -64,49        |
| 4.1 Cobros por emisión de valores de titulización  | 2.690.282       | 2.560.729     | 5,06          | 10.551.036                     | 30.457.387        | -65,36        | 25.249.628       | 71.111.978        | -64,49        |
| 4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)                | -51             | 0             | -             | -3.103                         | -1.556            | 99,42         | -5.106           | -14.471           | -64,72        |
| 5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros                                   | -3.859.410      | -5.284.231    | -26,96        | -14.270.414                    | -31.547.658       | -54,77        | -32.852.960      | -80.421.076       | -59,15        |
| 5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito   | -3.859.410      | -5.284.231    | -26,96        | -14.270.414                    | -31.547.658       | -54,77        | -32.852.960      | -80.421.076       | -59,15        |
| 5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras                                 | 0               | 0             | -             | 0                              | -                 | -             | 0                | -                 | -             |
| 6. Flujos de caja netos por amortizaciones   | 1.308.650       | 2.723.461     | -51,95        | 1.402.997                      | 5.218.795         | -73,12        | 5.526.128        | 8.954.833         | -38,29        |
| 6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito   | 2.059.185       | 2.941.150     | -29,99        | 25.735.829                     | 34.271.254        | -24,91        | 58.341.715       | 68.622.636        | -14,98        |
| 6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados                                   | 0               | 0             | -             | -4.589                         | 88.030            | -             | 0                | 246.185           | -100,00       |
| 6.3 Pagos por amortización de valores de titulización                                      | -750.535        | -217.689      | 244,77        | -24.328.243                    | -29.140.489       | -16,51        | -52.815.587      | -59.913.988       | -11,85        |
| 7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo                                      | 143.490         | 58.038        | 147,23        | 901.761                        | 4.995.342         | -81,95        | 4.416.785        | 10.951.328        | -59,67        |
| 7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos                        | 155.593         | 60.927        | 155,38        | 908.478                        | 7.924.077         | -88,54        | 4.293.206        | 13.944.898        | -69,21        |
| 7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos   | -8.817          | 0             | -             | 13.612                         | -2.764.231        | -             | -779.208         | -3.150.129        | -75,26        |
| 7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso  | -1.031          | -2.751        | -62,52        | 180.903                        | 6.952             | 2.502,17      | 585.919          | 263.637           | 122,24        |
| 7.4 Administraciones públicas - Pasivo   | -2.222          | 0             | -             | -776                           | -827              | -6,17         | -4.818           | -2.400            | 100,75        |
| 7.5 Otros deudores y acreedores  | -33             | -138          | -76,09        | -200.612                       | -170.458          | 17,69         | 321.686          | -104.507          | -             |
| 7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras                             | 0               | 0             | -             | 0                              | -                 | -             | 0                | -                 | -             |
| 7.7 Cobros de Subvenciones   | 0               | 0             | -             | 156                            | -171              | -             | 0                | -171              | -100,00       |
| <b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>                        | <b>297.830</b>  | <b>61.588</b> | <b>383,58</b> | <b>-1.018.214</b>              | <b>10.330.078</b> | <b>-</b>      | <b>3.585.878</b> | <b>12.638.847</b> | <b>-71,63</b> |
| Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo  | 264.609         | 248.657       | 6,42          | -4.104.027                     | -                 | -             | 36.112.464       | 29.318.759        | 23,17         |
| Efectivo o equivalentes al final del periodo   | 562.439         | 310.245       | 81,29         | -5.122.241                     | -                 | -             | 39.698.342       | 41.957.606        | -5,38         |

1 No incluye los Fondos Privados

| PERIODO  | DERECHOS DE CRÉDITO - PRINCIPALES RATIOS |         |                |                 |                              | % ACTIVOS NO<br>CORRIENTES EN<br>VENTA (6) | %PÉRDIDAS<br>REPERCUTIDAS (7) | VALORES EMTIDOS - MEJORAS |             |                             | INGRESOS Y GASTOS - PRINCIPALES RATIOS SEMESTRALES |                              |                  |
|--|--|---------|----------------|-----------------|------------------------------|--|-------------------------------|---------------------------|-------------|-----------------------------|--|------------------------------|------------------|
|  | TA (1)                                   | TAA (2) | DUDOSOS<br>(3) | FALLIDOS<br>(4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) |  |                               | % AVAL<br>(8)             | % FR<br>(9) | % LÍNEA DE<br>LIQUIDEZ (10) | RATIO<br>INTERESES (11)                            | % GASTOS<br>EXPLOTACION (12) | %COMISIONES (13) |
| <b>Fondos de titulación públicos - bonos</b>                             |  |         |                |                 |                              |  |                               |                           |             |                             |  |                              |                  |
| dic-12   | 360.937.047                              | 3,25    | 3,18           | 0,48            | 2,39                         | 0,29                                       | -0,98                         | 2,61                      | 8,41        | 1,59                        | 0,24   | -0,13                        | -0,11            |
| jun-12   | 411.896.368                              | 2,29    | 2,71           | 0,44            | 1,22                         | 0,27                                       | -0,82                         | 2,65                      | 5,49        | 1,13                        | 0,20   | -0,13                        | -0,11            |
| dic-11   | 455.751.455                              | 2,99    | 2,10           | 0,43            | 1,11                         | 0,23                                       | -0,71                         | 2,82                      | 7,39        | 1,52                        | 0,19   | -0,11                        | -0,08            |
| jun-11   | 465.439.228                              | 2,69    | 1,92           | 0,28            | 1,74                         | 0,23                                       | -0,59                         | 2,37                      | 4,66        | 1,20                        | 0,18   | -0,15                        | -0,13            |
| dic-10   | 484.209.039                              | 4,25    | 1,85           | 0,40            | 2,90                         | 0,16                                       | -0,53                         | 2,51                      | 5,70        | 1,94                        | 0,40   | -0,24                        | -0,22            |
| jun-10   | 456.719.249                              | 3,52    | 1,43           | 0,55            | 4,30                         | 0,10                                       | -0,47                         | 2,51                      | 3,33        | 0,71                        | 0,52   | -0,23                        | -0,22            |
| dic-09   | 478.014.950                              | -       | -              | -               | -                            | 0,08                                       | -0,38                         | 2,04                      | 3,10        | 0,77                        | 0,24   | -0,18                        | -0,16            |
| <b>Fondos de titulación públicos - bonos - sin titulación de cédulas</b> |  |         |                |                 |                              |  |                               |                           |             |                             |  |                              |                  |
| dic-12   | 246.165.412                              | 3,87    | 4,87           | 0,73            | 3,65                         | 0,43                                       | -1,44                         | 3,97                      | 12,71       | 1,93                        | 0,34   | -0,18                        | -0,16            |
| jun-12   | 286.302.949                              | 3,13    | 4,01           | 0,66            | 1,81                         | 0,39                                       | -1,17                         | 3,89                      | 8,03        | 1,16                        | 0,29   | -0,19                        | -0,16            |
| dic-11   | 322.716.165                              | 3,91    | 3,05           | 0,62            | 1,61                         | 0,33                                       | -1,00                         | 4,07                      | 10,59       | 1,70                        | 0,26   | -0,15                        | -0,12            |
| jun-11   | 322.825.758                              | 3,26    | 2,83           | 0,41            | 2,57                         | 0,32                                       | -0,85                         | 3,48                      | 6,71        | 1,37                        | 0,28   | -0,21                        | -0,18            |
| dic-10   | 327.781.093                              | 5,71    | 2,83           | 0,61            | 4,42                         | 0,23                                       | -0,78                         | 3,81                      | 8,51        | 2,13                        | 0,59   | -0,35                        | -0,32            |
| jun-10   | 301.516.850                              | 5,51    | 2,24           | 0,85            | 6,72                         | 0,15                                       | -0,71                         | 3,87                      | 5,04        | 0,26                        | 0,82   | -0,34                        | -0,33            |
| dic-09   | 322.133.497                              | -       | -              | -               | -                            | 0,11                                       | -0,56                         | -                         | -           | -                           | 0,36   | -0,26                        | -0,24            |
| <b>Fondos de titulación públicos - pagarés</b>                           |  |         |                |                 |                              |  |                               |                           |             |                             |  |                              |                  |
| dic-12   | 1.607.792                                | -       | 0,30           | 2,57            | 50,00                        | 0,04                                       | -0,37                         | -                         | 17,56       | 32,29                       | 1,10   | -1,42                        | -1,41            |
| jun-12   | 1.803.870                                | -       | 0,08           | -               | -                            | 0,04                                       | -0,56                         | -                         | 6,98        | 27,54                       | 1,06   | -0,03                        | -0,01            |
| dic-11   | 1.691.473                                | -       | -              | 0,02            | -                            | -  | -0,50                         | -                         | 5,09        | 27,45                       | 1,08   | -0,18                        | -0,15            |
| jun-11   | 2.332.627                                | -       | 0,22           | 0,85            | -                            | -  | -0,23                         | 0,05                      | 6,33        | 0,06                        | 0,24   | -0,39                        | -0,37            |
| dic-10   | 2.842.868                                | -       | -              | -               | -                            | -  | -0,06                         | -                         | 4,93        | 24,77                       | 0,45   | -0,41                        | -0,40            |
| jun-10   | 2.196.163                                | -       | -              | -               | -                            | -  | -0,05                         | -                         | 4,86        | -                           | 0,71   | -0,82                        | -0,79            |
| dic-09   | 3.127.507                                | 0,26    | -              | -               | -                            | -  | -1,62                         | -                         | 3,31        | 2,26                        | 1,85   | -0,12                        | -0,12            |

| PERIODO                                | DERECHOS DE CRÉDITO - PRINCIPALES RATIOS |         |                |                 |                              | % ACTIVOS NO<br>CORRIENTES EN<br>VENTA (6) | %PÉRDIDAS<br>REPERCUTIDAS (7) | VALORES EMTIDOS - MEJORAS |             |                             | INGRESOS Y GASTOS - PRINCIPALES RATIOS SEMESTRALES |                              |                  |
|--|--|---------|----------------|-----------------|------------------------------|--|-------------------------------|---------------------------|-------------|-----------------------------|--|------------------------------|------------------|
|  | TA (1)                                   | TAA (2) | DUDOSOS<br>(3) | FALLIDOS<br>(4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) |  |                               | % AVAL<br>(8)             | % FR<br>(9) | % LÍNEA DE<br>LIQUIDEZ (10) | RATIO<br>INTERESES (11)                            | % GASTOS<br>EXPLOTACION (12) | %COMISIONES (13) |
| <b>Fondos de titulización privados</b> |  |         |                |                 |                              |  |                               |                           |             |                             |  |                              |                  |
| dic-12                                 | 3.812.325                                | 5,81    | 4,17           | -               | 0,01                         | -  | -2,78                         | -                         | 3,26        | 1,86                        | 0,54   | -0,08                        | -0,08            |
| dic-11                                 | 3.655.797                                | 2,07    | 3,45           | 0,09            | 2,79                         | -  | -2,05                         | -                         | 4,13        | 1,97                        | 0,78   | -0,09                        | -0,09            |
| dic-10                                 | 3.143.463                                | 1,90    | 0,37           | 0,14            | 3,92                         | -  | -2,30                         | -                         | 3,03        | 2,13                        | 1,30   | -0,05                        | -0,04            |
| dic-09                                 | 3.127.507                                | 0,26    | -              | -               | -                            | -  | -1,62                         | -                         | 3,31        | 2,26                        | 1,85   | -0,12                        | -0,12            |

**Información sobre los encabezados**

(1) Total activo en miles de euros

(2) Tasa de amortización anticipada

(3) Tasa de dudosos: cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos y el principal pendiente del total activos

(4) Tasa de fallidos: cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos, y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en balance más el principal de los activos clasificados como fallidos

(5) Tasa de recuperación de fallidos: cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de los fallidos al cierre del mismo periodo del año anterior.

(6) Porcentaje que representa el valor en libros de los activos no corrientes en venta sobre el total activo

(7) Porcentaje que representa el importe de las pérdidas repercutidas a los pasivos sobre el total activo

(8) Porcentaje que representa el importe de los avales sobre los pasivos emitidos

(9) Porcentaje que representa el importe del fondo de reserva sobre los activos titulizados

(10) Porcentaje que representa el importe disponible en la línea de liquidez sobre los activos titulizados

(11) Porcentaje que representa la diferencia entre los intereses devengados de los derechos de crédito y de los valores emitidos, más el resultado de operaciones de cobertura, del semestre, sobre el total activo

(12) Porcentaje que representa el importe de otros gastos de explotación del semestre sobre el total activo

(13) Porcentaje que representa el importe de los gastos por comisiones del semestre sobre el total activo

|   | PERIODO | IMPORTE PENDIENTE<br>(miles €) | TAA (1) | % DEUDA /<br>VT (2) | DUDOSOS<br>(3) | FALLIDOS<br>(4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (6) | VIDA<br>RESIDUAL (7) | ANTIGÜEDAD<br>(8) | TASA CONCENTRACIÓN |                          |
|---|---------|--------------------------------|---------|---------------------|----------------|-----------------|------------------------------|----------------------|-------------------|--------------------|--------------------------|
|   |         |                                |         |                     |                |                 |                              |                      |                   | POR DEUDOR         | GEOGRÁFICA<br>/SECTORIAL |
| FONDOS PÚBLICOS                           |         |                                |         |                     |                |                 |                              |                      |                   |                    |                          |
| Hipotecarios                              | 2011 2  | 285.466.655                    | 2,20    | 33,23               | 1,55           | 0,30            | 1,00                         | 15,22                | 5,75              | 29,33              | 35,30                    |
|   | 2012 2  | 227.298.298                    | 2,77    | 31,09               | 2,39           | 0,37            | 1,34                         | 14,09                | 6,78              | 33,52              | 35,75                    |
| Empresas                                  | 2011 2  | 68.677.951                     | 5,67    | 38,53               | 4,58           | 0,81            | 2,21                         | 7,97                 | 3,67              | 15,58              | 14,93                    |
|   | 2012 2  | 46.239.510                     | 5,59    | 40,81               | 7,87           | 1,08            | 8,74                         | 7,53                 | 4,53              | 15,52              | 17,33                    |
| Deuda subordinada y<br>bonos de tesorería | 2011 2  | 3.408.379                      | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 1,23                 | 3,05              | 82,47              | 22,02                    |
|   | 2012 2  | 299.379                        | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 3,90                 | 6,15              | 100,00             | 40,00                    |
| AAPP                                      | 2011 2  | 2.121.469                      | 0,18    | 1,32                | 0,31           | 0,01            | 0,00                         | 1,45                 | 5,20              | 83,98              | 27,34                    |
|   | 2012 2  | 373.522                        | 0,95    | 5,12                | 2,84           | 0,00            | 0,00                         | 5,31                 | 8,91              | 34,44              | 80,43                    |
| Consumo y automoción                      | 2011 2  | 11.544.791                     | 5,18    | 5,46                | 6,53           | 2,62            | 0,05                         | 6,15                 | 3,22              | 0,69               | 45,39                    |
|   | 2012 2  | 8.956.637                      | 5,15    | 5,57                | 7,61           | 1,36            | 2,49                         | 5,72                 | 4,39              | 0,47               | 30,37                    |
| Cuentas a cobrar                          | 2011 2  | 0                              | -       | -                   | -              | -               | -                            | -                    | -                 | -                  | -                        |
|   | 2012 2  | 0                              | -       | -                   | -              | -               | -                            | -                    | -                 | -                  | -                        |
| Derechos de crédito<br>futuros            | 2011 2  | 0                              | -       | -                   | -              | -               | -                            | -                    | -                 | -                  | -                        |
|   | 2012 2  | 0                              | -       | -                   | -              | -               | -                            | -                    | -                 | -                  | -                        |
| Bonos de titulización                     | 2011 2  | 0                              | -       | -                   | -              | -               | -                            | -                    | -                 | -                  | -                        |
|   | 2012 2  | 0                              | -       | -                   | -              | -               | -                            | -                    | -                 | -                  | -                        |
| Otros                                     | 2011 2  | 26.642.589                     | 4,19    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 7,71                 | 2,12              | 80,49              | 66,97                    |
|   | 2012 2  | 25.684.363                     | 2,53    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 9,28                 | 2,32              | 86,53              | 75,78                    |
| Pagarés                                   | 2011 2  | 1.507.904                      | 0,00    | -                   | 0,00           | 0,02            | 0,00                         | 0,01                 | 2,97              | 5,27               | -                        |
|   | 2012 2  | 1.288.284                      | 0,00    | -                   | 0,30           | 2,57            | 50,00                        | 0,00                 | 0,00              | 46,05              | -                        |
| FONDOS PRIVADOS                           | 2011 2  | 3.096.098                      | 2,07    | -                   | 3,45           | 0,09            | 2,79                         | 3,66                 | 20,56             | 52,89              | -                        |
|   | 2012 2  | 3.088.224                      | 5,81    | -                   | 4,17           | 0,00            | 0,01                         | 3,51                 | 5,47              | 49,97              | -                        |

(1) Tasa de amortización anticipada

(2) Porcentaje que representa la deuda total sobre el valor de tasación de la garantía

(3) Tasa de dudosos: cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos y el principal pendiente del total activos

(4) Tasa de fallidos: cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos el principal pendiente del total de los activos

(6) Tasa de recuperación de fallidos: cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos al cierre anual anterior y el importe de principal pendiente de reembolso de activos clasificados como fallidos al cierre anual anterior.

(7) Vida residual media ponderada valorada en años

(8) Antigüedad media ponderada valorada en años

## Listado de fondos a 31 de diciembre de 2012

| FONDO                                   |     | TIPO  | GESTORA | CEDEnte                           | TOTAL ACTIVO   |            |
|---|-----|-------|---------|-----------------------------------|--|------------|
| AYT ANDALUCIA FTEMPRESA CAJAMAR, FTA    | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | CAJAMAR CAJA RURAL, S.C.C.   | 180.977    |
| AYT CAIXA GALICIA EMPRESAS I, FTA       | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | NOVACAIXAGALICIA   | 273.123    |
| AYT CAIXA SABADELL HIPOTECARIO I, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | UNNIM BANC, S.A  | 248.476    |
| AYT CAIXANOVA FTPYME I, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | NOVACAIXAGALICIA   | 76.527     |
| AYT CAIXANOVA HIPOTECARIO I, FTA        | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | NOVACAIXAGALICIA   | 183.837    |
| AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA              | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 940.980    |
| AYT CAJA MURCIA HIPOTECARIO I, FTA      | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO MARENOSTRUM, S.A.  | 126.979    |
| AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA      | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO MARENOSTRUM, S.A.  | 203.662    |
| AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FTA      | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO MARENOSTRUM, S.A.  | 146.972    |
| AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 39.112.570 |
| AYT CEDULAS CAJAS IV, FTA               | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 4.033.297  |
| AYT CEDULAS CAJAS IX, FTA               | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 5.237.902  |
| AYT CEDULAS CAJAS V, FTA                | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 3.199.209  |
| AYT CEDULAS CAJAS VI, FTA               | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 3.470.554  |
| AYT CEDULAS CAJAS VIII, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 4.227.723  |
| AYT CEDULAS CAJAS X, FTA                | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 4.095.305  |
| AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FTA    | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 553.034    |
| AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 4.912.981  |
| AYT DEUDA SUBORDINADA I, FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 337.200    |
| AYT FONDO EOLICO, FTA                   | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | OTROS  | 20.314     |
| AYT FTPYME II, FTA                      | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 93.767     |
| AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA           | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | BARCLAYS BANK, S.A.  | 3.813.092  |
| AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | BARCLAYS BANK, S.A.  | 1.255.720  |
| AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | BARCLAYS BANK, S.A.  | 1.427.792  |
| AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA              | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA                    | 506.554    |
| AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA                    | 621.697    |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FTA           | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 162.747    |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 116.730    |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, FTA           | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 158.653    |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 348.176    |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO, FTA              | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 101.351    |
| AYT ICO FTVPO CAIXA GALICIA I, FTA      | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | NOVACAIXAGALICIA   | 139.449    |
| AYT ICO-FTVPO CAJA MURCIA, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO MARENOSTRUM, S.A.  | 121.813    |
| AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA     | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A. | CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKO AURREZKI KUTXA | 128.758    |

## Listado de fondos a 31 de diciembre de 2012

| FONDO                                   |     | TIPO  |         | GESTORA                                 | CEDENTE   | TOTAL ACTIVO |
|---|-----|-------|---------|---|---|--------------|
| AYT ICO-FTVPO I, FTA                    | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | MULTICEDENTE  | 257.327      |
| AYT ICO-FTVPO III, FTA                  | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | MULTICEDENTE  | 207.007      |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SEBASTIAN | 459.666      |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA           | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SEBASTIAN | 803.063      |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO IV, FTA           | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SEBASTIAN | 1.860.958    |
| AYT PRESTAMOS CONSUMO III, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | MULTICEDENTE  | 29.817       |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS II, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | CAIXABANK   | 80.424       |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS III, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SEBASTIAN | 77.256       |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS IV, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | CAIXABANK   | 103.629      |
| AYT SA NOSTRA FINANCIACION I, FTA       | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | BANCO MARENOSTRUM, S.A.                                       | 21.872       |
| AYT UNICAJA FINANCIACION I, FTA         | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | UNICAJA   | 186.377      |
| AYT VPO II, FTA                         | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | MULTICEDENTE  | 126.255      |
| AYT.7, PROMOCIONES INMOBILIARIAS I, FTA | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | MULTICEDENTE  | 33.557       |
| ICO MEDIACION I AYT, FTA                | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL                                  | 707.010      |
| ICO MEDIACION II AYT FTA                | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL                                  | 16.705.800   |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS III, FTA    | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | BANKIA  | 819.465      |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS IV, FTA     | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | BANKIA  | 852.225      |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS V, FTA      | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | BANKIA  | 1.189.609    |
| UNICAJA AYT EMPRESAS I, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | UNICAJA   | 151.481      |
| BANCAJA - BVA VPO 1, FTA                | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE  | 333.266      |
| BANCAJA 10, FTA                         | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA    | 1.607.151    |
| BANCAJA 11, FTA                         | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA    | 1.344.451    |
| BANCAJA 13, FTA                         | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA    | 2.580.166    |
| BANCAJA 3, FTA                          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA    | 166.423      |
| BANCAJA 5, FTA                          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA    | 214.785      |
| BANCAJA 6, FTA                          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA    | 491.032      |
| BANCAJA 7, FTA                          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA    | 582.050      |
| BANCAJA 8, FTA                          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA    | 656.461      |



## Listado de fondos a 31 de diciembre de 2012

| FONDO                     |     | TIPO  |         | GESTORA                                 | CEDENTE  | TOTAL ACTIVO |
|---------------------------|-----|-------|---------|---|--|--------------|
| BANCAJA 9, FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 934.600      |
| BANCAJA LEASING 1, FTA    | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 560.870      |
| BANKINTER 10, FTA         | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANKINTER, S.A.  | 770.523      |
| BANKINTER 13 FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANKINTER, S.A.  | 944.056      |
| BANKINTER 2 PYME FTA      | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANKINTER, S.A.  | 232.849      |
| BANKINTER 3 FTPYME FTA    | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANKINTER, S.A.  | 271.351      |
| BANKINTER 4 FTPYME, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANKINTER, S.A.  | 231.268      |
| BANKINTER 6, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANKINTER, S.A.  | 448.385      |
| BANKINTER 8, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANKINTER, S.A.  | 355.991      |
| BANKINTER 9, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANKINTER, S.A.  | 455.535      |
| BBVA AUTOS 1 FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 30.300       |
| BBVA AUTOS 2 FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 132.628      |
| BBVA CONSUMO 1, FTA       | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 179.895      |
| BBVA CONSUMO 2, FTA       | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 223.998      |
| BBVA CONSUMO 3 FTA        | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE   | 213.811      |
| BBVA CONSUMO 4 FTA        | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | FINANZIA, BANCO DE CREDITO, S.A.                           | 671.674      |
| BBVA CONSUMO 5, FTA       | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE   | 1.074.470    |
| BBVA EMPRESAS 1, FTA      | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 240.909      |
| BBVA EMPRESAS 2, FTA      | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 1.400.498    |
| BBVA EMPRESAS 3, FTA      | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 1.170.194    |
| BBVA EMPRESAS 4, FTA      | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 1.232.349    |
| BBVA EMPRESAS 5, FTA      | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 939.617      |
| BBVA EMPRESAS 6, FTA      | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 1.055.200    |
| BBVA FINANZIA AUTOS 1 FTA | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 120.736      |
| BBVA HIPOTECARIO 3, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 219.915      |
| BBVA LEASING 1, FTA       | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 360.602      |
| BBVA RMBS 1, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 1.715.166    |
| BBVA RMBS 10, FTA         | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 1.737.356    |
| BBVA RMBS 11, FTA         | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 1.615.150    |
| BBVA RMBS 2, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 3.313.732    |
| BBVA RMBS 3, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 2.183.731    |
| BBVA RMBS 5 FTA           | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 3.939.007    |
| BBVA RMBS 9, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 1.431.552    |
| BBVA-3 FTPYME FTA         | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 59.894       |
| BBVA-4 PYME, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 74.049       |

## Listado de fondos a 31 de diciembre de 2012

| FONDO                           |     | TIPO  |         | GESTORA                                 |  | CEDENTE  | TOTAL ACTIVO |
|---------------------------------|-----|-------|---------|---|--|--|--------------|
| BBVA-5 FTPYME, FTA              | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 194.585      |
| BBVA-6 FTPYME FTA               | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 220.202      |
| BBVA-7 FTGENCAT, FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 53.234       |
| BBVA-8 FTPYME FTA               | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 286.992      |
| BCL MUNICIPIOS I FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                      | 133.296      |
| CONSUMO BANCAJA 1, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 21.005       |
| EDT FTPYME PASTOR 3, FTA        | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | BANCO PASTOR, S.A.   | 51.802       |
| FTPYME BANCAJA 2 FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 41.341       |
| FTPYME BANCAJA 3 FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 74.608       |
| FTPYME BANCAJA 6 FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 189.786      |
| MBS BANCAJA 1 FTA               | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 121.819      |
| MBS BANCAJA 2, FTA              | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 262.014      |
| MBS BANCAJA 3, FTA              | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 350.124      |
| MBS BANCAJA 4, FTA              | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 1.013.683    |
| MBS BANCAJA 6, FTA              | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 834.029      |
| MBS BANCAJA 7, FTA              | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 833.146      |
| MBS BANCAJA 8, FTA              | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 432.659      |
| PYME BANCAJA 5, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 140.465      |
| PYME BANCAJA 7, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 561.356      |
| PYME VALENCIA 1, FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | BANCO DE VALENCIA, S.A.                                    | 196.856      |
| PYME VALENCIA 2, FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | BANCO DE VALENCIA, S.A.                                    | 272.848      |
| RURAL CEDULA I, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | MULTICEDENTE   | 1.118.979    |
| RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | MULTICEDENTE   | 458.750      |
| RURAL HIPOTECARIO IX, FTA       | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | MULTICEDENTE   | 920.276      |
| RURAL HIPOTECARIO V FTA         | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | MULTICEDENTE   | 195.865      |
| RURAL HIPOTECARIO VI, FTA       | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | MULTICEDENTE   | 325.803      |
| RURAL HIPOTECARIO VII, FTA      | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | MULTICEDENTE   | 428.424      |
| RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA     | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. |  | MULTICEDENTE   | 669.264      |

## Listado de fondos a 31 de diciembre de 2012

| FONDO                              |     | TIPO  |         | GESTORA                                    | CEDENTE  | TOTAL ACTIVO |
|------------------------------------|-----|-------|---------|--|--|--------------|
| RURAL HIPOTECARIO X, FTA           | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | MULTICEDENTE   | 1.364.405    |
| RURAL HIPOTECARIO XI, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | MULTICEDENTE   | 1.760.556    |
| RURAL HIPOTECARIO XII, FTA         | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | MULTICEDENTE   | 826.477      |
| RURALPYME 1 FTPYME FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | MULTICEDENTE   | 31.640       |
| RURALPYME 2 FTPYME FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | MULTICEDENTE   | 164.775      |
| VAL BANCAJA 1, FTA                 | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 283.741      |
| VALENCIA HIPOTECARIO 1, FTA        | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | BANCO DE VALENCIA, S.A.                                    | 145.002      |
| VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA        | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | BANCO DE VALENCIA, S.A.                                    | 517.586      |
| VALENCIA HIPOTECARIO 4, FTA        | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | BANCO DE VALENCIA, S.A.                                    | 673.801      |
| VALENCIA HIPOTECARIO 5, FTA        | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | BANCO DE VALENCIA, S.A.                                    | 421.820      |
| FONCAIXA AUTONOMOS 1, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | CAIXABANK  | 1.100.556    |
| FONCAIXA CONSUMO 1, FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | CAIXABANK  | 2.648.967    |
| FONCAIXA EMPRESAS 3, FTA           | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | CAIXABANK  | 1.114.727    |
| FONCAIXA FTGENCAT 3, FTA           | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | CAIXABANK  | 170.342      |
| FONCAIXA FTGENCAT 4, FTA           | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | CAIXABANK  | 212.805      |
| FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA           | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | CAIXABANK  | 539.452      |
| FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA           | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | CAIXABANK  | 385.446      |
| FONCAIXA LEASINGS 1, FTA           | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | CAIXABANK  | 1.091.283    |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 1, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | UNNIM  | 111.707      |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 2, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | UNNIM  | 153.300      |
| GC FTGENCAT CAIXA TARRAGONA 1, FTA | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | CATALUNYA BANC, S.A.                                       | 138.276      |
| GC FTGENCAT SABADELL 1, FTA        | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | BANCO DE SABADELL, S.A.                                    | 105.004      |
| GC FTPYME PASTOR 4, FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | BANCO PASTOR, S.A.   | 93.868       |
| GC FTPYME SABADELL 4, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | BANCO DE SABADELL, S.A.                                    | 115.014      |
| GC FTPYME SABADELL 5, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | BANCO DE SABADELL, S.A.                                    | 240.351      |
| GC FTPYME SABADELL 6, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | BANCO DE SABADELL, S.A.                                    | 264.278      |
| GC FTPYME SABADELL 8, FTA          | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | BANCO DE SABADELL, S.A.                                    | 642.426      |
| GC FTPYME UNNIM 1, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | UNNIM  | 260.275      |
| GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA       | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | BANCO PASTOR, S.A.   | 402.844      |
| GC SABADELL EMPRESAS 2, FTA        | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | BANCO DE SABADELL, S.A.                                    | 268.066      |
| GC SABADELL EMPRESAS 4, FTA        | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | BANCO DE SABADELL, S.A.                                    | 296.556      |
| FINANCAT 1, FTA                    | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.                                       | 118.528      |
| GAT FTGENCAT 2005, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 81.260       |
| GAT FTGENCAT 2006, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.                                       | 66.763       |
| GAT FTGENCAT 2007, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 168.543      |
| GAT FTGENCAT 2008, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE   | 306.856      |

## Listado de fondos a 31 de diciembre de 2012

| FONDO                              |     | TIPO  | GESTORA |  | CEDEnte                          | TOTAL ACTIVO |
|------------------------------------|-----|-------|---------|--|----------------------------------|--------------|
| GAT FTGENCAT 2009, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 319.098      |
| HIPOCAT 10, FTA                    | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 692.306      |
| HIPOCAT 11, FTA                    | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 709.153      |
| HIPOCAT 14, FTA                    | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 405.010      |
| HIPOCAT 16, FTA                    | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 634.699      |
| HIPOCAT 17, FTA                    | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 811.530      |
| HIPOCAT 18, FTA                    | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 679.972      |
| HIPOCAT 19, FTA                    | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 628.573      |
| HIPOCAT 20, FTA                    | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 833.265      |
| HIPOCAT 4, FTA                     | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 58.140       |
| HIPOCAT 5, FTA                     | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 153.760      |
| HIPOCAT 6, FTA                     | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 238.340      |
| HIPOCAT 7, FTA                     | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 487.888      |
| HIPOCAT 8, FTA                     | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 590.705      |
| HIPOCAT 9, FTA                     | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 459.666      |
| MBSCAT 1, FTA                      | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 729.464      |
| MBSCAT 2, FTA                      | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 338.876      |
| PYMECAT 2 FTPYME, FTA              | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 146.754      |
| PYMECAT 3 FTPYME, FTA              | FTA | BONOS | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | CATALUNYA BANC, S.A.             | 364.866      |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, FTA | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | MULTICEDENTE                     | 2.243.898    |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 5, FTA | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | MULTICEDENTE                     | 2.419.254    |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 1, FTA     | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.      | 206.733      |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 2, FTA     | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.      | 467.304      |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 3, FTA     | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.      | 1.122.145    |
| IM BANCO POPULAR MBS 2, FTA        | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.      | 634.996      |
| IM BANKOA MBS 1, FTA               | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | BANKOA, S.A.                     | 422.631      |
| IM BCG RMBS 1, FTA                 | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | BANCO CAIXA GERAL, S.A.          | 357.226      |
| IM BES EMPRESAS 1, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | BANCO ESPIRITO SANTO, S.A., S.E. | 394.944      |
| IM CAJA LABORAL 1, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | CAJA LABORAL POPULAR C.C.        | 470.202      |
| IM CAJA LABORAL 2, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | CAJA LABORAL POPULAR C.C.        | 513.545      |
| IM CAJA LABORAL EMPRESAS 1, FTA    | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | CAJA LABORAL POPULAR C.C.        | 364.913      |
| IM CAJAMAR 1, FTA                  | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | CAJAMAR CAJA RURAL, S.C.C.       | 127.392      |
| IM CAJAMAR 3, FTA                  | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | CAJAMAR CAJA RURAL, S.C.C.       | 603.675      |
| IM CAJAMAR 4, FTA                  | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | CAJAMAR CAJA RURAL, S.C.C.       | 581.434      |
| IM CAJAMAR 5, FTA                  | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | CAJAMAR CAJA RURAL, S.C.C.       | 683.659      |
| IM CAJAMAR 6, FTA                  | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | CAJAMAR CAJA RURAL, S.C.C.       | 1.445.472    |

## Listado de fondos a 31 de diciembre de 2012

| FONDO                                  |     | TIPO  |         | GESTORA                                 | CEDENTE                      | TOTAL ACTIVO |
|--|-----|-------|---------|---|------------------------------|--------------|
| IM CAJAMAR EMPRESAS 2 FTPYME, FTA      | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | CAJAMAR CAJA RURAL, S.C.C.   | 188.824      |
| IM CAJAMAR EMPRESAS 4, FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | CAJAMAR CAJA RURAL, S.C.C.   | 978.223      |
| IM CAJASTUR MBS 1, FTA                 | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | OTROS BANCOS                 | 640.960      |
| IM CEDULAS 1 GRUPO BANCO POPULAR, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.  | 2.249.336    |
| IM CEDULAS 10, FTA                     | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | MULTICEDENTE                 | 1.352.025    |
| IM CEDULAS 14, FTA                     | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | MULTICEDENTE                 | 1.295.732    |
| IM CEDULAS 15, FTA                     | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | MULTICEDENTE                 | 872.383      |
| IM CEDULAS 2, FTA                      | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | MULTICEDENTE                 | 1.513.453    |
| IM CEDULAS 3, FTA                      | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | MULTICEDENTE                 | 1.065.044    |
| IM CEDULAS 4, FTA                      | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | MULTICEDENTE                 | 2.143.382    |
| IM CEDULAS 5, FTA                      | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | MULTICEDENTE                 | 1.282.281    |
| IM CEDULAS 7, FTA                      | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | MULTICEDENTE                 | 1.296.454    |
| IM CEDULAS 9, FTA                      | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | MULTICEDENTE                 | 1.306.966    |
| IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO DE SABADELL, S.A.      | 181.933      |
| IM FTGENCAT SABADELL 3, FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO DE SABADELL, S.A.      | 93.222       |
| IM FTGENCAT SABADELL 4, FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO DE SABADELL, S.A.      | 189.762      |
| IM FTPYME SABADELL 3, FTA              | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO DE SABADELL, S.A.      | 77.400       |
| IM FTPYME SABADELL 7, FTA              | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO DE SABADELL, S.A.      | 378.204      |
| IM FTPYME SABADELL 9, FTA              | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO DE SABADELL, S.A.      | 1.326.857    |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, FTA | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.  | 357.855      |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 3, FTA | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.  | 2.527.380    |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 4, FTA | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.  | 1.537.744    |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I FTA    | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.  | 478.908      |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME II, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.  | 324.811      |
| IM GRUPO BANCO POPULAR LEASING 2, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.  | 1.080.954    |
| IM PASTOR 4, FTA                       | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.  | 441.787      |
| IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, FTA       | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO SANTANDER, S.A.        | 186.499      |
| IM SABADELL EMPRESAS 1, FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO DE SABADELL, S.A.      | 197.296      |
| IM SABADELL EMPRESAS 3, FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO DE SABADELL, S.A.      | 876.773      |
| IM SABADELL EMPRESAS 5, FTA            | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO DE SABADELL, S.A.      | 313.220      |
| IM SABADELL RMBS 2, FTA                | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO DE SABADELL, S.A.      | 885.863      |
| IM SABADELL RMBS 3, FTA                | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | BANCO DE SABADELL, S.A.      | 989.448      |
| IM TERRASSA 1 FTGENCAT FTA             | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | OTROS BANCOS                 | 61.860       |
| IM TERRASSA MBS 1, FTA                 | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA | 221.562      |
| INTERMONEY MASTER CEDULAS, FTA         | FTA | BONOS | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | MULTICEDENTE                 | 1.664.759    |
| EMPRESAS BANESTO 2, FTA                | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.   | BANCO SANTANDER, S.A.        | 621.967      |

## Listado de fondos a 31 de diciembre de 2012

| FONDO  |     | TIPO  |         | GESTORA                               | CEDENTE               | TOTAL ACTIVO |
|--|-----|-------|---------|---------------------------------------|-----------------------|--------------|
| EMPRESAS BANESTO 5, FTA                                    | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 922.485      |
| EMPRESAS BANESTO 6, FTA                                    | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 927.421      |
| FTA PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZ. DE CED. HIPOTECARIA | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 1.230.309    |
| FINANCIACION BANESTO 1, FTA                                | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 40.796       |
| FTA FTPYME SANTANDER 1                                     | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 279.329      |
| FTA FTPYME SANTANDER 2                                     | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 373.176      |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 07-1                     | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 217.163      |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2011-1                   | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 724.480      |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 10, FTA                             | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 2.786.880    |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 2                                   | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 380.003      |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 4                                   | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 793.633      |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 8, FTA                              | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 3.551.774    |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 9, FTA                              | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 2.594.378    |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 1                               | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 167.275      |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 5                               | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 781.828      |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2                                | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 951.029      |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3                                | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 1.600.356    |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 6                                | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 1.101.208    |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 7                                | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 1.898.426    |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 8                                | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 865.952      |
| FTA SANTANDER PUBLICO 1                                    | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 319.592      |
| FTA UCI 11   | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 268.533      |
| FTA UCI 14   | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 682.414      |
| FTA UCI 16   | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 1.110.557    |
| FTA UCI 18   | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 1.177.183    |
| FTA UCI 6  | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 55.023       |
| FTA UCI 7  | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 65.089       |
| FTA UCI 8  | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 89.812       |
| FTA UCI 9  | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 245.083      |
| FTA, HIPOTEBANSA 11  | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 246.285      |
| FTA, HIPOTEBANSA X   | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 144.524      |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 1                                  | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 378.227      |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 3                                  | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 749.233      |
| FTA, UCI 15  | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 790.894      |
| FTA, UCI 17  | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 957.442      |
| PYMES BANESTO 2, FTA                                       | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. | 243.103      |

## Listado de fondos a 31 de diciembre de 2012

| FONDO  |     | TIPO  |         | GESTORA                                 | CEDENTE  | TOTAL ACTIVO |
|--|-----|-------|---------|---|--|--------------|
| SANTANDER CONSUMER SPAIN 09-1, FTA                           | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.   | BANCO SANTANDER, S.A.                                      | 244.807      |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2010-1, FTA                    | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.   | BANCO SANTANDER, S.A.                                      | 358.036      |
| SANTANDER HIPOTECARIO I, FTA                                 | FTA | BONOS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.   | BANCO SANTANDER, S.A.                                      | 649.836      |
| CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA                                     | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES                               | 518.549      |
| CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA                                     | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES                               | 435.682      |
| CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA                           | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES                               | 272.013      |
| CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA                               | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES                               | 226.978      |
| CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA                                   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | COPERATIVAS DE CRÉDITO                                     | 245.270      |
| CEDULAS TDA 15, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE   | 1.409.533    |
| CEDULAS TDA 17, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE   | 1.239.167    |
| CEDULAS TDA 18, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE   | 881.911      |
| CEDULAS TDA 2, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE   | 2.068.019    |
| CEDULAS TDA 21, FONDO DE TITULIZACION                        | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE   | 2.916.156    |
| CEDULAS TDA 3, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE   | 2.145.195    |
| CEDULAS TDA 5, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE   | 1.575.988    |
| CEDULAS TDA 6, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE   | 3.113.685    |
| CEDULAS TDA 7, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE   | 2.042.541    |
| CIBELES III FTPYME, FTA                                      | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID                | 82.374       |
| CM BANCAJA 1, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 88.238       |
| DRIVER ESPAÑA ONE, FTA                                       | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | OTROS BANCOS   | 310.977      |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 3, FTA                          | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO                           | 229.421      |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 5, FTA                          | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO                           | 622.626      |
| FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE   | 15.838.633   |
| FTPYME TDA 6, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | BANCO GUIPUZCOANO, S.A.                                    | 22.178       |
| FTPYME TDA 7, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | BANCO GUIPUZCOANO, S.A.                                    | 82.040       |
| FTPYME TDA CAM 2, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO                           | 92.017       |
| FTPYME TDA CAM 4, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO                           | 384.189      |
| FTPYME TDA CAM 7, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO                           | 573.526      |
| FTPYME TDA CAM 9, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO                           | 485.163      |
| MADRID CONSUMO I, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID                | 207.131      |
| MADRID FTPYME I, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID                | 895.306      |
| MADRID FTPYME II, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | BANKIA   | 746.474      |

## Fondos de titulización

CUADRO 00

## Listado de fondos a 31 de diciembre de 2012

| FONDO                      | TIPO | GESTORA | TIPO    | TIPO                                    | TIPO  | TIPO | TOTAL ACTIVO |
|----------------------------|------|---------|---------|---|---|------|--------------|
| MADRID ICO-FTVPO I, FTA    | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID |      | 213.441      |
| MADRID RESIDENCIAL I, FTA  | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID |      | 685.624      |
| MADRID RESIDENCIAL II, FTA | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID |      | 602.410      |
| MADRID RMBS I, FTA         | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID |      | 1.047.173    |
| MADRID RMBS II, FTA        | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID |      | 934.814      |
| MADRID RMBS III FTA        | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID |      | 1.752.167    |
| MADRID RMBS IV, FTA        | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID |      | 1.499.507    |
| PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA  | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 10.948.625   |
| SOL-LION, FTA              | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | ING DIRECT N.V. S.E.                        |      | 3.507.189    |
| TDA 13 - MIXTO, FTA        | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 57.321       |
| TDA 14 - MIXTO, FTA        | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 111.422      |
| TDA 15 - MIXTO, FTA        | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 113.063      |
| TDA 16 - MIXTO, FTA        | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 120.135      |
| TDA 17 - MIXTO, FTA        | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 97.147       |
| TDA 18 - MIXTO, FTA        | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 120.132      |
| TDA 19 - MIXTO, FTA        | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 190.731      |
| TDA 20 - MIXTO, FTA        | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 144.544      |
| TDA 22 - MIXTO, FTA        | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 182.832      |
| TDA 23, FTA                | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 310.807      |
| TDA 24, FTA                | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 217.760      |
| TDA 25, FTA                | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 149.427      |
| TDA 26 - MIXTO, FTA        | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 380.732      |
| TDA 27, FTA                | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 526.685      |
| TDA 28, FTA                | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 313.799      |
| TDA 29, FTA                | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE                                |      | 471.018      |
| TDA 30, FTA                | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | BANCA MARCH, S.A.                           |      | 294.785      |
| TDA 31, FTA                | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | BANCO GUIPUZCOANO, S.A.                     |      | 191.283      |
| TDA CAJAMAR 2, FTA         | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJAMAR CAJA RURAL, S.C.C.                  |      | 395.068      |
| TDA CAM 1, FTA             | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO            |      | 238.468      |
| TDA CAM 10, FTA            | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO            |      | 755.163      |
| TDA CAM 11, FTA            | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO            |      | 1.298.007    |
| TDA CAM 12, FTA            | FTA  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO            |      | 1.514.865    |



## Listado de fondos a 31 de diciembre de 2012

| FONDO   |     | TIPO  |         | GESTORA                                 | CEDENTE   | TOTAL ACTIVO       |
|---|-----|-------|---------|---|---|--------------------|
| TDA CAM 2, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO  | 273.989            |
| TDA CAM 3, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO  | 305.081            |
| TDA CAM 4, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO  | 714.279            |
| TDA CAM 5, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO  | 980.111            |
| TDA CAM 6, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO  | 657.430            |
| TDA CAM 7, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO  | 984.866            |
| TDA CAM 8, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO  | 978.438            |
| TDA CAM 9, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO  | 897.093            |
| TDA CORPORATIVOS I, FTA                                       | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MULTICEDENTE  | 660.904            |
| TDA EMPRESAS 1, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | BANCO GUIPUZCOANO, S.A.   | 61.492             |
| TDA EMPRESAS 2, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | BANCO GUIPUZCOANO, S.A.   | 111.017            |
| TDA FTPYME PASTOR 9, FTA                                      | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | BANCO PASTOR, S.A.  | 338.879            |
| TDA IBERCAJA 1, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y RIOJA               | 181.257            |
| TDA IBERCAJA 2, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y RIOJA               | 413.690            |
| TDA IBERCAJA 3, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y RIOJA               | 501.855            |
| TDA IBERCAJA 4, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y RIOJA               | 754.392            |
| TDA IBERCAJA 5, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y RIOJA               | 728.872            |
| TDA IBERCAJA 6, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y RIOJA               | 1.102.987          |
| TDA IBERCAJA 7, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y RIOJA               | 1.770.991          |
| TDA PASTOR 1, FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | BANCO PASTOR, S.A.  | 104.425            |
| TDA PASTOR CONSUMO 1, FTA                                     | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | BANCO PASTOR, S.A.  | 31.464             |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA                                 | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES                           | 74.229             |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA                                 | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES                           | 168.257            |
| TDA TARRAGONA 1, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA   | 284.165            |
| UNICAJA ANDALUCIA FTVIVIENDA TDA 1, FTA                       | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, ALMERIA, MALAGA Y ANTEQ | 175.543            |
| UNICAJA TDA VPO, FTA  | FTA | BONOS | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, ALMERIA, MALAGA Y ANTEQ | 163.646            |
| <b>Subtotal FTA/BONOS constituidos en periodos anteriores</b> |     |       |         |   |   | <b>338.521.537</b> |
| BBVA-9 PYME FTA   | FTA | BONOS | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.                                       | 557.434            |

## Fondos de titulización

CUADRO 00

## Listado de fondos a 31 de diciembre de 2012

| FONDO   |     | TIPO    |         | GESTORA                                 | CEDENTE  | TOTAL ACTIVO       |
|---|-----|---------|---------|---|--|--------------------|
| FONCAIXA PYMES 3, FTA   | FTA | BONOS   | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.              | CAIXABANK  | 2.646.410          |
| IM CFS RMBS 1, FTA  | FTA | BONOS   | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | OTROS BANCOS   | 390.543            |
| IM CITI TARJETAS 1, FTA   | FTA | BONOS   | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | CITIBANK ESPAÑA, S.A.                                      | 1.245.482          |
| FTA PYMES SANTANDER 3   | FTA | BONOS   | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.   | BANCO SANTANDER, S.A.                                      | 1.740.334          |
| FTA PYMES SANTANDER 4   | FTA | BONOS   | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.   | BANCO SANTANDER, S.A.                                      | 3.179.992          |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2012-1                        | FTA | BONOS   | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.   | BANCO SANTANDER, S.A.                                      | 580.868            |
| AUTO ABS 2012-3, FTA  | FTA | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | BANQUE PSA FINANCE S.E.                                    | 847.100            |
| TDA LICO LEASING III, FTA                                       | FTA | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | LICO LEASING, S.A., E.F.C.                                 | 143.095            |
| <b>Subtotal FTA/BONOS constituidos en el periodo</b>            |     |         |         |   |  | <b>11.331.258</b>  |
| <b>Total FTA/BONOS</b>  |     |         |         |   |  | <b>349.852.795</b> |
| FTA SANTANDER 2   | FTA | PAGARÉS | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.   | BANCO SANTANDER, S.A.                                      | 1.607.792          |
| <b>Subtotal FTA/PAGARÉS constituidos en periodos anteriores</b> |     |         |         |   |  | <b>1.607.792</b>   |
| <b>Subtotal FTA/PAGARÉS constituidos en el periodo</b>          |     |         |         |   |  | <b>0</b>           |
| <b>Total FTA/PAGARÉS</b>  |     |         |         |   |  | <b>1.607.792</b>   |
| <b>Total FTA - PÚBLICOS</b>                                     |     |         |         |   |  | <b>351.460.587</b> |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO II, FTH                                  | FTH | BONOS   | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | BARCLAYS BANK, S.A.  | 243.974            |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO III, FTH                                 | FTH | BONOS   | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | BARCLAYS BANK, S.A.  | 276.178            |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, FTH                                  | FTH | BONOS   | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | BARCLAYS BANK, S.A.  | 308.176            |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH                                  | FTH | BONOS   | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | BARCLAYS BANK, S.A.  | 605.957            |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH                                  | FTH | BONOS   | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | BARCLAYS BANK, S.A.  | 324.369            |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH                                 | FTH | BONOS   | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | BARCLAYS BANK, S.A.  | 715.624            |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH                                | FTH | BONOS   | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | BARCLAYS BANK, S.A.  | 1.069.024          |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH                                   | FTH | BONOS   | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | BARCLAYS BANK, S.A.  | 681.800            |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH                                  | FTH | BONOS   | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | BARCLAYS BANK, S.A.  | 841.452            |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH                                 | FTH | BONOS   | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | BARCLAYS BANK, S.A.  | 591.477            |
| AYT HIPOTECARIO III, FTH  | FTH | BONOS   | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | MULTICEDENTE   | 83.864             |
| AYT HIPOTECARIO IV, FTH   | FTH | BONOS   | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | MULTICEDENTE   | 74.534             |
| AYT.1, FTH  | FTH | BONOS   | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | MULTICEDENTE   | 36.004             |
| AYT.11, FTH   | FTH | BONOS   | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | MULTICEDENTE   | 90.704             |
| AYT.2, FTH  | FTH | BONOS   | PÚBLICO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.       | MULTICEDENTE   | 18.174             |
| BANCAJA 4, FTH  | FTH | BONOS   | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 183.417            |
| BANKINTER 11, FTH   | FTH | BONOS   | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANKINTER, S.A.  | 468.543            |
| BANKINTER 12, FTH   | FTH | BONOS   | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANKINTER, S.A.  | 626.504            |
| BANKINTER 2, FTH  | FTH | BONOS   | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. | BANKINTER, S.A.  | 37.986             |

## Fondos de titulización

CUADRO 00

Listado de fondos a 31 de diciembre de 2012

| FONDO   | TIPO | GESTORA | TIPO    | CEDEnte                                    | TOTAL ACTIVO  |                    |
|---|------|---------|---------|--|---|--------------------|
| BANKINTER 3, FTH  | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | BANKINTER, S.A.   | 256.626            |
| BANKINTER 4, FTH  | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | BANKINTER, S.A.   | 257.217            |
| BANKINTER 5, FTH  | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | BANKINTER, S.A.   | 179.929            |
| BANKINTER 7, FTH  | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | BANKINTER, S.A.   | 159.712            |
| RURAL HIPOTECARIO II FTH                                | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | MULTICEDENTE  | 26.017             |
| RURAL HIPOTECARIO III FTH                               | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | MULTICEDENTE  | 56.499             |
| RURAL HIPOTECARIO IV FTH                                | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | MULTICEDENTE  | 110.813            |
| VALENCIA HIPOTECARIO 2, FTH                             | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | BANCO DE VALENCIA, S.A.                                       | 439.317            |
| GC SABADELL 1, FTH                                      | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | BANCO DE SABADELL, S.A.                                       | 364.304            |
| GAT ICO-FTVPO 1, FTH                                    | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | GESTION DE ACTIVOS TITULIZADOS, SGFT, S.A. | MULTICEDENTE  | 267.545            |
| IM PASTOR 2, FTH  | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.                                   | 273.312            |
| IM PASTOR 3, FTH  | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.    | BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.                                   | 353.317            |
| FTH UCI 10  | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.      | BANCO SANTANDER, S.A.   | 180.192            |
| FTH UCI 12  | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.      | BANCO SANTANDER, S.A.   | 364.887            |
| FTH UCI 5   | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.      | BANCO SANTANDER, S.A.   | 25.486             |
| TDA 11, FTH   | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.    | MULTICEDENTE  | 63.225             |
| TDA 12, FTH   | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.    | MULTICEDENTE  | 58.030             |
| TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH                             | FTH  | BONOS   | PÚBLICO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.    | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y RIOJA | 370.063            |
| <b>Subtotal FTH constituidos en periodos anteriores</b> |      |         |         |  |   | <b>11.084.252</b>  |
| <b>Subtotal FTH constituidos en el periodo</b>          |      |         |         |  |   | <b>0</b>           |
| <b>Total FTH - PÚBLICOS</b>                             |      |         |         |  |   | <b>11.084.252</b>  |
| <b>Total FONDOS PUBLICOS</b>                            |      |         |         |  |   | <b>362.544.839</b> |
| AYT ADMINISTRACIONES I, FTA                             | FTA  | BONOS   | PRIVADO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.          | MULTICEDENTE  | 132.622            |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES II, FTA                    | FTA  | BONOS   | PRIVADO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.          | MULTICEDENTE  | 319.921            |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES III, FTA                   | FTA  | BONOS   | PRIVADO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.          | MULTICEDENTE  | 268.535            |
| AYT LICO LEASING I, FTA                                 | FTA  | BONOS   | PRIVADO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.          | LICO LEASING, S.A., E.F.C.                                    | 64.681             |
| AYT PRESTIGE CAJAS DE AHORRO, FTA                       | FTA  | BONOS   | PRIVADO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.          | MULTICEDENTE  | 171.635            |
| AYT.10, FINANCIACION INVERSIONES, FTA                   | FTA  | BONOS   | PRIVADO | AHORRO Y TITULIZACION, SGFT, S.A.          | MULTICEDENTE  | 315.942            |
| VALENCIA ACTIVOS 1, FTA                                 | FTA  | BONOS   | PRIVADO | EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.    | BANCO DE VALENCIA, S.A.                                       | 1.076.736          |
| GC COMPASS SPAIN 2, FTA                                 | FTA  | BONOS   | PRIVADO | GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.                 | URALITA   | 60.940             |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA Nº 2, FTA                   | FTA  | BONOS   | PRIVADO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.    | BANCO FINANTIA SOFINLOC, S.A.                                 | 13.832             |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA Nº 3, FTA                   | FTA  | BONOS   | PRIVADO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.    | BANCO FINANTIA SOFINLOC, S.A.                                 | 16.882             |
| CAJA SAN FERNANDO CDO I, FTA                            | FTA  | BONOS   | PRIVADO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.    | CAJA DE AHORROS PROVINCIAL SAN FERNANDO DE SEVILLA Y JEREZ    | 49.615             |

## Fondos de titulización

CUADRO 00

Listado de fondos a 31 de diciembre de 2012

| FONDO  |     | TIPO  |         | GESTORA                                 | CEDENTE  | TOTAL ACTIVO     |
|--|-----|-------|---------|---|--|------------------|
| CAP-TDA 2, FTA   | FTA | BONOS | PRIVADO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | GRUPO DRAGADOS   | 393.724          |
| EMPRESAS TDA CAM 10, FTA   | FTA | BONOS | PRIVADO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO                           | 557.251          |
| MORTGAGE FINANCE SPAIN, FTA  | FTA | BONOS | PRIVADO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CALYON, SUCURSAL EN ESPAÑA                                 | 217.565          |
| SOFINLOC ESPAÑA TDA Nº 1, FTA  | FTA | BONOS | PRIVADO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | BANCO FINANTIA SOFINLOC, S.A.                              | 28.847           |
| TDA FS1, FTA   | FTA | BONOS | PRIVADO | TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. | CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA | 123.597          |
| <b>Subtotal FTA/PRIVADOS/BONOS constituidos en periodos anteriores</b>   |     |       |         |   |  | <b>3.812.325</b> |
| <b>Subtotal FTA/PRIVADOS/BONOS constituidos en el periodo</b>            |     |       |         |   |  | <b>0</b>         |
| <b>Total FTA/PRIVADOS/BONOS</b>  |     |       |         |   |  | <b>3.812.325</b> |
| <b>Subtotal FTA/PRIVADOS/PAGARÉS constituidos en periodos anteriores</b> |     |       |         |   |  | <b>0</b>         |
| <b>Subtotal FTA/PRIVADOS/PAGARÉS constituidos en el periodo</b>          |     |       |         |   |  | <b>0</b>         |
| <b>Total FTA/PRIVADOS/PAGARÉS</b>  |     |       |         |   |  | <b>0</b>         |
| <b>Total FONDOS PRIVADOS</b>   |     |       |         |   |  | <b>3.812.325</b> |

Nota: Importes en miles de euros

| FONDO                                   | TIPO | ACTIVO              |                                |       | PASIVO                                   |                                 | DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO) |
|---|------|---------------------|--------------------------------|-------|--|---------------------------------|-----------------------------|
|   |      | DERECHOS DE CRÉDITO | ACTIVOS NO CORRIENTES EN VENTA |       | OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES | DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO |                             |
| AUTO ABS 2012-3, FTA                    | FTA  | BONOS               | 774.772                        | 0     | 802.373                                  | 40.218                          | 0                           |
| AYT ANDALUCIA FTEMPRESA CAJAMAR, FTA    | FTA  | BONOS               | 152.142                        | 0     | 155.656                                  | 24.999                          | -4.332                      |
| AYT CAIXA GALICIA EMPRESAS I, FTA       | FTA  | BONOS               | 219.314                        | 0     | 256.982                                  | 820                             | 290                         |
| AYT CAIXA SABADELL HIPOTECARIO I, FTA   | FTA  | BONOS               | 238.349                        | 0     | 241.336                                  | 1.343                           | -22.367                     |
| AYT CAIXANOVA FTPYME I, FTA             | FTA  | BONOS               | 48.881                         | 0     | 56.377                                   | 19.698                          | -878                        |
| AYT CAIXANOVA HIPOTECARIO I, FTA        | FTA  | BONOS               | 168.822                        | 0     | 179.232                                  | 95                              | -6.131                      |
| AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA              | FTA  | BONOS               | 859.992                        | 0     | 864.564                                  | 72.930                          | 0                           |
| AYT CAJA MURCIA HIPOTECARIO I, FTA      | FTA  | BONOS               | 121.879                        | 0     | 124.487                                  | 1.754                           | -7.250                      |
| AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA      | FTA  | BONOS               | 195.345                        | 0     | 197.576                                  | 5.205                           | -12.539                     |
| AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FTA      | FTA  | BONOS               | 133.240                        | 0     | 137.408                                  | 1.680                           | -2.599                      |
| AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA            | FTA  | BONOS               | 37.189.599                     | 0     | 37.182.845                               | 1.919.323                       | 0                           |
| AYT CEDULAS CAJAS IV, FTA               | FTA  | BONOS               | 3.923.485                      | 0     | 3.923.266                                | 109.790                         | 0                           |
| AYT CEDULAS CAJAS IX, FTA               | FTA  | BONOS               | 5.145.775                      | 0     | 5.144.617                                | 91.941                          | 0                           |
| AYT CEDULAS CAJAS V, FTA                | FTA  | BONOS               | 3.111.915                      | 0     | 3.111.104                                | 86.902                          | 0                           |
| AYT CEDULAS CAJAS VI, FTA               | FTA  | BONOS               | 3.398.138                      | 0     | 3.397.283                                | 72.243                          | 0                           |
| AYT CEDULAS CAJAS VIII, FTA             | FTA  | BONOS               | 4.121.049                      | 0     | 4.120.101                                | 106.702                         | 0                           |
| AYT CEDULAS CAJAS X, FTA                | FTA  | BONOS               | 3.938.518                      | 0     | 3.938.041                                | 155.384                         | 0                           |
| AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FTA    | FTA  | BONOS               | 395.550                        | 0     | 416.814                                  | 119.516                         | -9.500                      |
| AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA | FTA  | BONOS               | 4.576.595                      | 0     | 4.685.739                                | 142.551                         | -107.054                    |
| AYT DEUDA SUBORDINADA I, FTA            | FTA  | BONOS               | 280.766                        | 0     | 298.139                                  | 39.011                          | 0                           |
| AYT FONDO EOLICO, FTA                   | FTA  | BONOS               | 15.382                         | 0     | 15.366                                   | 0                               | 0                           |
| AYT FTPYME II, FTA                      | FTA  | BONOS               | 71.589                         | 0     | 75.679                                   | 11.848                          | -1.552                      |
| AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA           | FTA  | BONOS               | 3.508.455                      | 66    | 3.528.066                                | 282.569                         | -161.488                    |
| AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA            | FTA  | BONOS               | 1.157.970                      | 0     | 1.186.460                                | 66.009                          | -56.152                     |
| AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA             | FTA  | BONOS               | 1.305.624                      | 0     | 1.336.993                                | 86.511                          | -72.653                     |
| AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA              | FTA  | BONOS               | 465.228                        | 0     | 476.203                                  | 23.075                          | -10.520                     |
| AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA             | FTA  | BONOS               | 577.818                        | 0     | 589.657                                  | 21.599                          | -7.836                      |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FTA           | FTA  | BONOS               | 155.123                        | 0     | 156.404                                  | 5.867                           | -16.842                     |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA          | FTA  | BONOS               | 112.368                        | 2.599 | 116.384                                  | 77                              | -6.298                      |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, FTA           | FTA  | BONOS               | 145.138                        | 0     | 149.677                                  | 5.549                           | -7.040                      |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA            | FTA  | BONOS               | 337.494                        | 0     | 341.245                                  | 5.808                           | -14.374                     |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO, FTA              | FTA  | BONOS               | 81.902                         | 506   | 83.055                                   | 18.269                          | -310                        |
| AYT ICO FTVPO CAIXA GALICIA I, FTA      | FTA  | BONOS               | 123.074                        | 0     | 125.632                                  | 13.105                          | -3.730                      |
| AYT ICO-FTVPO CAJA MURCIA, FTA          | FTA  | BONOS               | 109.492                        | 0     | 111.055                                  | 10.115                          | -9.505                      |

| FONDO                                   | TIPO |       | ACTIVO              |                                | PASIVO                                   |                                 | DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO) |
|---|------|-------|---------------------|--------------------------------|--|---------------------------------|-----------------------------|
|   |      |       | DERECHOS DE CRÉDITO | ACTIVOS NO CORRIENTES EN VENTA | OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES | DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO |                             |
| AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA     | FTA  | BONOS | 116.116             | 0                              | 119.319                                  | 8.522                           | -1.893                      |
| AYT ICO-FTVPO I, FTA                    | FTA  | BONOS | 226.239             | 0                              | 233.289                                  | 12.301                          | 6.149                       |
| AYT ICO-FTVPO III, FTA                  | FTA  | BONOS | 183.861             | 0                              | 188.651                                  | 14.832                          | -8.114                      |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA            | FTA  | BONOS | 426.275             | 0                              | 435.750                                  | 13.521                          | -10.302                     |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA           | FTA  | BONOS | 757.397             | 0                              | 783.962                                  | 13.085                          | -57.755                     |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO IV, FTA           | FTA  | BONOS | 1.524.397           | 0                              | 1.647.582                                | 102.132                         | -76.926                     |
| AYT PRESTAMOS CONSUMO III, FTA          | FTA  | BONOS | 17.894              | 0                              | 22.109                                   | 7.089                           | -161                        |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS II, FTA   | FTA  | BONOS | 49.260              | 0                              | 49.594                                   | 29.993                          | -232                        |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS III, FTA  | FTA  | BONOS | 70.120              | 0                              | 71.896                                   | 5.217                           | -1.935                      |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS IV, FTA   | FTA  | BONOS | 50.105              | 0                              | 51.211                                   | 51.273                          | -875                        |
| AYT SA NOSTRA FINANCIACION I, FTA       | FTA  | BONOS | 12.859              | 0                              | 13.997                                   | 7.788                           | -196                        |
| AYT UNICAJA FINANCIACION I, FTA         | FTA  | BONOS | 120.332             | 0                              | 140.720                                  | 44.375                          | -3.123                      |
| AYT VPO II, FTA                         | FTA  | BONOS | 110.666             | 0                              | 114.994                                  | 10.571                          | -6.930                      |
| AYT.7, PROMOCIONES INMOBILIARIAS I, FTA | FTA  | BONOS | 23.867              | 0                              | 25.083                                   | 7.988                           | 0                           |
| BANCAJA - BVA VPO 1, FTA                | FTA  | BONOS | 297.183             | 0                              | 303.458                                  | 23.274                          | -26.035                     |
| BANCAJA 10, FTA                         | FTA  | BONOS | 1.572.097           | 0                              | 1.592.132                                | 4.218                           | -32.489                     |
| BANCAJA 11, FTA                         | FTA  | BONOS | 1.319.864           | 0                              | 1.339.404                                | 1.818                           | -31.000                     |
| BANCAJA 13, FTA                         | FTA  | BONOS | 2.362.266           | 0                              | 2.386.960                                | 182.692                         | -33.223                     |
| BANCAJA 3, FTA                          | FTA  | BONOS | 154.899             | 0                              | 155.948                                  | 2.605                           | 1.226                       |
| BANCAJA 5, FTA                          | FTA  | BONOS | 203.377             | 0                              | 207.539                                  | 5.013                           | -4.792                      |
| BANCAJA 6, FTA                          | FTA  | BONOS | 461.084             | 0                              | 465.377                                  | 20.829                          | -8.193                      |
| BANCAJA 7, FTA                          | FTA  | BONOS | 565.576             | 0                              | 569.311                                  | 7.357                           | -8.336                      |
| BANCAJA 8, FTA                          | FTA  | BONOS | 614.259             | 0                              | 645.512                                  | 0                               | -10.817                     |
| BANCAJA 9, FTA                          | FTA  | BONOS | 909.325             | 0                              | 920.869                                  | 3.248                           | -19.227                     |
| BANCAJA LEASING 1, FTA                  | FTA  | BONOS | 432.571             | 0                              | 459.709                                  | 100.961                         | 0                           |
| BANKINTER 10, FTA                       | FTA  | BONOS | 744.309             | 558                            | 767.013                                  | 0                               | -13.269                     |
| BANKINTER 13 FTA                        | FTA  | BONOS | 897.642             | 2.635                          | 934.795                                  | 539                             | -18.168                     |
| BANKINTER 2 PYME FTA                    | FTA  | BONOS | 207.445             | 440                            | 225.555                                  | 0                               | -3.774                      |
| BANKINTER 3 FTPYME FTA                  | FTA  | BONOS | 253.802             | 1.262                          | 269.481                                  | 358                             | -4.390                      |
| BANKINTER 4 FTPYME, FTA                 | FTA  | BONOS | 192.364             | 752                            | 193.240                                  | 37.311                          | -3.734                      |
| BANKINTER 6, FTA                        | FTA  | BONOS | 424.994             | 302                            | 432.686                                  | 13.516                          | -8.346                      |
| BANKINTER 8, FTA                        | FTA  | BONOS | 340.539             | 91                             | 343.410                                  | 10.712                          | -5.764                      |
| BANKINTER 9, FTA                        | FTA  | BONOS | 429.549             | 219                            | 438.786                                  | 13.754                          | -8.607                      |
| BBVA AUTOS 1 FTA                        | FTA  | BONOS | 9.141               | 36                             | 10.082                                   | 19.799                          | 36                          |

| FONDO                              | TIPO |       | ACTIVO              |                                | PASIVO                                   |                                 | DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO) |
|------------------------------------|------|-------|---------------------|--------------------------------|--|---------------------------------|-----------------------------|
|                                    |      |       | DERECHOS DE CRÉDITO | ACTIVOS NO CORRIENTES EN VENTA | OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES | DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO |                             |
| BBVA AUTOS 2 FTA                   | FTA  | BONOS | 102.731             | 28                             | 112.460                                  | 15.758                          | -12.963                     |
| BBVA CONSUMO 1, FTA                | FTA  | BONOS | 133.180             | 101                            | 151.882                                  | 21.125                          | -21.489                     |
| BBVA CONSUMO 2, FTA                | FTA  | BONOS | 189.008             | 185                            | 197.447                                  | 20.740                          | -21.987                     |
| BBVA CONSUMO 3 FTA                 | FTA  | BONOS | 180.398             | 40                             | 199.913                                  | 11.934                          | -20.802                     |
| BBVA CONSUMO 4 FTA                 | FTA  | BONOS | 427.631             | 0                              | 461.561                                  | 206.788                         | -43.579                     |
| BBVA CONSUMO 5, FTA                | FTA  | BONOS | 602.230             | 0                              | 653.238                                  | 413.187                         | -86.304                     |
| BBVA EMPRESAS 1, FTA               | FTA  | BONOS | 196.672             | 2.037                          | 211.736                                  | 28.115                          | -2.455                      |
| BBVA EMPRESAS 2, FTA               | FTA  | BONOS | 874.796             | 4.157                          | 926.239                                  | 472.039                         | -2.321                      |
| BBVA EMPRESAS 3, FTA               | FTA  | BONOS | 724.513             | 7.871                          | 724.548                                  | 443.952                         | -26.884                     |
| BBVA EMPRESAS 4, FTA               | FTA  | BONOS | 580.356             | 2.646                          | 639.497                                  | 590.626                         | -20.639                     |
| BBVA EMPRESAS 5, FTA               | FTA  | BONOS | 667.526             | 1.810                          | 691.357                                  | 245.331                         | -22.416                     |
| BBVA EMPRESAS 6, FTA               | FTA  | BONOS | 842.234             | 0                              | 907.033                                  | 143.288                         | -41.015                     |
| BBVA FINANZIA AUTOS 1 FTA          | FTA  | BONOS | 104.009             | 0                              | 115.682                                  | 0                               | -14.598                     |
| BBVA HIPOTECARIO 3, FTA            | FTA  | BONOS | 179.649             | 5.811                          | 177.965                                  | 22.313                          | -2.514                      |
| BBVA LEASING 1, FTA                | FTA  | BONOS | 341.435             | 230                            | 359.048                                  | 0                               | -8.993                      |
| BBVA RMBS 1, FTA                   | FTA  | BONOS | 1.571.381           | 31.673                         | 1.571.679                                | 41.769                          | -1.486                      |
| BBVA RMBS 10, FTA                  | FTA  | BONOS | 1.523.357           | 292                            | 1.536.989                                | 192.398                         | -36.317                     |
| BBVA RMBS 11, FTA                  | FTA  | BONOS | 1.371.490           | 274                            | 1.386.085                                | 221.086                         | 0                           |
| BBVA RMBS 2, FTA                   | FTA  | BONOS | 3.085.348           | 69.283                         | 3.103.760                                | 48.760                          | -36.379                     |
| BBVA RMBS 3, FTA                   | FTA  | BONOS | 2.073.729           | 84.974                         | 2.177.255                                | 0                               | -17.020                     |
| BBVA RMBS 5 FTA                    | FTA  | BONOS | 3.499.214           | 76.064                         | 3.473.621                                | 458.848                         | -54.423                     |
| BBVA RMBS 9, FTA                   | FTA  | BONOS | 1.156.116           | 3.460                          | 1.159.211                                | 266.665                         | -40.615                     |
| BBVA-3 FTPYME FTA                  | FTA  | BONOS | 42.207              | 190                            | 45.904                                   | 11.008                          | -631                        |
| BBVA-4 PYME, FTA                   | FTA  | BONOS | 62.666              | 2.371                          | 58.356                                   | 13.781                          | -927                        |
| BBVA-5 FTPYME, FTA                 | FTA  | BONOS | 174.504             | 9.694                          | 171.528                                  | 17.096                          | -3.942                      |
| BBVA-6 FTPYME FTA                  | FTA  | BONOS | 210.837             | 4.866                          | 214.676                                  | 0                               | -6.609                      |
| BBVA-7 FTGENCAT, FTA               | FTA  | BONOS | 48.824              | 462                            | 48.068                                   | 4.934                           | -978                        |
| BBVA-8 FTPYME FTA                  | FTA  | BONOS | 263.727             | 6.878                          | 253.078                                  | 33.592                          | -4.774                      |
| BBVA-9 PYME FTA                    | FTA  | BONOS | 464.541             | 0                              | 469.525                                  | 85.303                          | 0                           |
| BCL MUNICIPIOS I FTA               | FTA  | BONOS | 96.432              | 0                              | 102.292                                  | 30.352                          | 532                         |
| CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA           | FTA  | BONOS | 492.332             | 0                              | 502.199                                  | 12.427                          | -9.362                      |
| CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA           | FTA  | BONOS | 405.025             | 0                              | 415.412                                  | 16.535                          | -4.112                      |
| CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA | FTA  | BONOS | 222.260             | 0                              | 228.122                                  | 42.965                          | -1.452                      |
| CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA     | FTA  | BONOS | 209.493             | 0                              | 211.383                                  | 13.431                          | -1.308                      |

| FONDO  | TIPO | ACTIVO              |                                |        | PASIVO                                   |                                 | DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO) |
|--|------|---------------------|--------------------------------|--------|--|---------------------------------|-----------------------------|
|  |      | DERECHOS DE CRÉDITO | ACTIVOS NO CORRIENTES EN VENTA |        | OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES | DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO |                             |
| CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA                                 | FTA  | BONOS               | 210.718                        | 0      | 214.366                                  | 29.959                          | 0                           |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, FTA                         | FTA  | BONOS               | 2.057.692                      | 0      | 2.057.611                                | 170.664                         | 0                           |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 5, FTA                         | FTA  | BONOS               | 2.419.123                      | 0      | 2.419.031                                | 0                               | 0                           |
| CEDULAS TDA 15, FTA  | FTA  | BONOS               | 1.351.881                      | 0      | 1.351.882                                | 57.568                          | 0                           |
| CEDULAS TDA 17, FTA  | FTA  | BONOS               | 1.159.675                      | 0      | 1.159.675                                | 79.023                          | 0                           |
| CEDULAS TDA 18, FTA  | FTA  | BONOS               | 820.256                        | 0      | 820.406                                  | 61.359                          | 0                           |
| CEDULAS TDA 2, FTA   | FTA  | BONOS               | 2.008.647                      | 0      | 2.008.630                                | 58.831                          | 0                           |
| CEDULAS TDA 21, FONDO DE TITULIZACION                      | FTA  | BONOS               | 2.651.238                      | 0      | 2.651.237                                | 241.170                         | 0                           |
| CEDULAS TDA 3, FTA   | FTA  | BONOS               | 2.072.521                      | 0      | 2.072.356                                | 64.131                          | 0                           |
| CEDULAS TDA 5, FTA   | FTA  | BONOS               | 1.505.425                      | 0      | 1.505.425                                | 57.957                          | 0                           |
| CEDULAS TDA 6, FTA   | FTA  | BONOS               | 3.070.705                      | 0      | 3.070.705                                | 0                               | 0                           |
| CEDULAS TDA 7, FTA   | FTA  | BONOS               | 2.037.400                      | 0      | 2.037.205                                | 0                               | 0                           |
| CIBELES III FTPYME, FTA                                    | FTA  | BONOS               | 41.655                         | 0      | 41.594                                   | 38.354                          | -246                        |
| CM BANCAJA 1, FTA  | FTA  | BONOS               | 72.648                         | 0      | 88.157                                   | 24                              | -297                        |
| CONSUMO BANCAJA 1, FTA                                     | FTA  | BONOS               | 18.282                         | 0      | 20.754                                   | 0                               | -259                        |
| DRIVER ESPAÑA ONE, FTA                                     | FTA  | BONOS               | 278.349                        | 0      | 258.551                                  | 16.888                          | -5.037                      |
| EDT FTPYME PASTOR 3, FTA                                   | FTA  | BONOS               | 39.088                         | 5.773  | 36.952                                   | 14.710                          | -2.472                      |
| EMPRESAS BANESTO 2, FTA                                    | FTA  | BONOS               | 465.875                        | 14.228 | 507.320                                  | 113.143                         | -7.177                      |
| EMPRESAS BANESTO 5, FTA                                    | FTA  | BONOS               | 638.881                        | 5.244  | 657.946                                  | 262.433                         | 7                           |
| EMPRESAS BANESTO 6, FTA                                    | FTA  | BONOS               | 650.339                        | 0      | 926.155                                  | 0                               | -8.091                      |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 3, FTA                        | FTA  | BONOS               | 220.818                        | 0      | 210.416                                  | 16.684                          | -1.616                      |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 5, FTA                        | FTA  | BONOS               | 607.380                        | 0      | 610.629                                  | 9.526                           | -2.414                      |
| FTA PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZ. DE CED. HIPOTECARIA | FTA  | BONOS               | 1.227.781                      | 0      | 1.225.691                                | 0                               | 0                           |
| FINANCAT 1, FTA  | FTA  | BONOS               | 104.871                        | 19     | 115.682                                  | 0                               | -823                        |
| FINANCIACION BANESTO 1, FTA                                | FTA  | BONOS               | 33.075                         | 145    | 39.919                                   | 0                               | -1.668                      |
| FONCAIXA AUTONOMOS 1, FTA                                  | FTA  | BONOS               | 892.843                        | 0      | 934.133                                  | 156.701                         | 2.383                       |
| FONCAIXA CONSUMO 1, FTA                                    | FTA  | BONOS               | 2.438.024                      | 0      | 2.482.322                                | 152.268                         | 2.235                       |
| FONCAIXA EMPRESAS 3, FTA                                   | FTA  | BONOS               | 921.343                        | 0      | 980.964                                  | 127.602                         | -422                        |
| FONCAIXA FTGENCAT 3, FTA                                   | FTA  | BONOS               | 158.711                        | 0      | 166.814                                  | 3.209                           | -4.961                      |
| FONCAIXA FTGENCAT 4, FTA                                   | FTA  | BONOS               | 194.854                        | 0      | 207.847                                  | 3.842                           | -7.549                      |
| FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA                                   | FTA  | BONOS               | 499.217                        | 0      | 536.833                                  | 0                               | -21.371                     |
| FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA                                   | FTA  | BONOS               | 368.066                        | 0      | 384.686                                  | 0                               | -11.346                     |
| FONCAIXA LEASINGS 1, FTA                                   | FTA  | BONOS               | 849.664                        | 0      | 882.534                                  | 200.567                         | 4.307                       |



| FONDO                                    | TIPO |       | ACTIVO              |                                | PASIVO                                   |                                 | DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO) |
|--|------|-------|---------------------|--------------------------------|--|---------------------------------|-----------------------------|
|  |      |       | DERECHOS DE CRÉDITO | ACTIVOS NO CORRIENTES EN VENTA | OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES | DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO |                             |
| FONCAIXA PYMES 3, FTA                    | FTA  | BONOS | 2.263.897           | 0                              | 2.401.457                                | 241.247                         | 0                           |
| FTA FTPYME SANTANDER 1                   | FTA  | BONOS | 247.520             | 1.331                          | 255.635                                  | 18.073                          | -1.773                      |
| FTA FTPYME SANTANDER 2                   | FTA  | BONOS | 323.453             | 2.505                          | 334.825                                  | 18.037                          | 735                         |
| FTA PYMES SANTANDER 3                    | FTA  | BONOS | 1.237.593           | 0                              | 1.740.144                                | 0                               | 0                           |
| FTA PYMES SANTANDER 4                    | FTA  | BONOS | 2.349.828           | 0                              | 3.179.763                                | 0                               | 0                           |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 07-1   | FTA  | BONOS | 159.010             | 0                              | 200.357                                  | 0                               | -3.399                      |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2011-1 | FTA  | BONOS | 571.400             | 0                              | 720.139                                  | 508                             | -38.893                     |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2012-1 | FTA  | BONOS | 489.554             | 0                              | 426.381                                  | 150.959                         | 0                           |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 10, FTA           | FTA  | BONOS | 1.669.793           | 578                            | 2.781.823                                | 0                               | -33.571                     |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 2                 | FTA  | BONOS | 307.645             | 9.195                          | 367.270                                  | 0                               | -1.369                      |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 4                 | FTA  | BONOS | 728.924             | 18.829                         | 792.139                                  | 0                               | -5.407                      |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 8, FTA            | FTA  | BONOS | 1.957.805           | 22.513                         | 3.532.179                                | 0                               | 14.250                      |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 9, FTA            | FTA  | BONOS | 1.506.293           | 17.476                         | 2.593.698                                | 0                               | -17.129                     |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 1             | FTA  | BONOS | 138.817             | 202                            | 153.414                                  | 0                               | 2.086                       |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 5             | FTA  | BONOS | 563.935             | 1.413                          | 781.030                                  | 0                               | -36.517                     |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2              | FTA  | BONOS | 900.051             | 9.904                          | 932.353                                  | 0                               | -4.849                      |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3              | FTA  | BONOS | 1.515.221           | 37.059                         | 1.587.960                                | 0                               | -14.753                     |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 6              | FTA  | BONOS | 772.099             | 7.371                          | 970.144                                  | 0                               | 130.455                     |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 7              | FTA  | BONOS | 1.509.279           | 971                            | 1.880.749                                | 0                               | 17.420                      |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 8              | FTA  | BONOS | 687.237             | 371                            | 858.858                                  | 0                               | 5.555                       |
| FTA SANTANDER PUBLICO 1                  | FTA  | BONOS | 287.746             | 0                              | 304.817                                  | 13.968                          | -2.602                      |
| FTA UCI 11                               | FTA  | BONOS | 253.427             | 1.963                          | 251.204                                  | 12.755                          | 0                           |
| FTA UCI 14                               | FTA  | BONOS | 641.278             | 18.631                         | 615.416                                  | 21.759                          | 0                           |
| FTA UCI 16                               | FTA  | BONOS | 1.066.505           | 42.922                         | 1.048.206                                | 775                             | 0                           |
| FTA UCI 18                               | FTA  | BONOS | 1.140.947           | 10.622                         | 1.133.061                                | 97                              | -19.217                     |
| FTA UCI 6                                | FTA  | BONOS | 49.714              | 0                              | 50.352                                   | 4.582                           | 0                           |
| FTA UCI 7                                | FTA  | BONOS | 61.436              | 26                             | 61.511                                   | 3.417                           | 0                           |
| FTA UCI 8                                | FTA  | BONOS | 83.605              | 107                            | 83.535                                   | 6.007                           | 0                           |
| FTA UCI 9                                | FTA  | BONOS | 231.292             | 798                            | 229.647                                  | 12.510                          | 0                           |
| FTA, HIPOTEBANSA 11                      | FTA  | BONOS | 227.323             | 631                            | 232.800                                  | 5.576                           | -2.933                      |
| FTA, HIPOTEBANSA X                       | FTA  | BONOS | 134.702             | 169                            | 135.739                                  | 3.466                           | -2.215                      |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 1                | FTA  | BONOS | 325.443             | 2.085                          | 336.419                                  | 27.730                          | -1.257                      |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 3                | FTA  | BONOS | 640.916             | 8.983                          | 715.696                                  | 0                               | 2.066                       |
| FTA, UCI 15                              | FTA  | BONOS | 743.565             | 24.836                         | 736.731                                  | 0                               | 0                           |

| FONDO  | TIPO | ACTIVO              |                                |  | PASIVO                          |         | DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO) |
|--|------|---------------------|--------------------------------|--|---------------------------------|---------|-----------------------------|
|  |      | DERECHOS DE CRÉDITO | ACTIVOS NO CORRIENTES EN VENTA | OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES | DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO |         |                             |
| FTA, UCI 17  | FTA  | BONOS               | 924.890                        | 30.969                                   | 929.044                         | 1.621   | -23.165                     |
| FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA | FTA  | BONOS               | 14.417.193                     | 0  | 15.799.628                      | 0       | 0                           |
| FTPYME BANCAJA 2 FTA   | FTA  | BONOS               | 34.348                         | 0  | 34.653                          | 5.302   | -270                        |
| FTPYME BANCAJA 3 FTA   | FTA  | BONOS               | 58.866                         | 0  | 53.661                          | 5.925   | -1.285                      |
| FTPYME BANCAJA 6 FTA   | FTA  | BONOS               | 188.165                        | 0  | 189.700                         | 0       | -1.825                      |
| FTPYME TDA 6, FTA  | FTA  | BONOS               | 19.412                         | 0  | 19.792                          | 1.515   | -98                         |
| FTPYME TDA 7, FTA  | FTA  | BONOS               | 75.526                         | 0  | 81.088                          | 0       | 64                          |
| FTPYME TDA CAM 2, FTA  | FTA  | BONOS               | 81.406                         | 0  | 77.536                          | 9.362   | -243                        |
| FTPYME TDA CAM 4, FTA  | FTA  | BONOS               | 379.097                        | 0  | 382.602                         | 1.087   | -3.201                      |
| FTPYME TDA CAM 7, FTA  | FTA  | BONOS               | 517.692                        | 0  | 501.678                         | 66.364  | 3.345                       |
| FTPYME TDA CAM 9, FTA  | FTA  | BONOS               | 421.675                        | 0  | 199.164                         | 278.789 | 0                           |
| GAT FTGENCAT 2005, FTA                                       | FTA  | BONOS               | 62.425                         | 45                                       | 64.839                          | 16.019  | -391                        |
| GAT FTGENCAT 2006, FTA                                       | FTA  | BONOS               | 64.710                         | 898                                      | 66.671                          | 0       | -532                        |
| GAT FTGENCAT 2007, FTA                                       | FTA  | BONOS               | 159.056                        | 2.417                                    | 149.318                         | 190     | -1.612                      |
| GAT FTGENCAT 2008, FTA                                       | FTA  | BONOS               | 271.561                        | 538                                      | 292.790                         | 12.535  | -166                        |
| GAT FTGENCAT 2009, FTA                                       | FTA  | BONOS               | 279.652                        | 340                                      | 70.623                          | 246.042 | 0                           |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 1, FTA                            | FTA  | BONOS               | 100.944                        | 0  | 111.077                         | 0       | -2.858                      |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 2, FTA                            | FTA  | BONOS               | 109.905                        | 0  | 148.409                         | 0       | 4.468                       |
| GC FTGENCAT CAIXA TARRAGONA 1, FTA                           | FTA  | BONOS               | 115.659                        | 0  | 133.777                         | 0       | 3.019                       |
| GC FTGENCAT SABADELL 1, FTA                                  | FTA  | BONOS               | 93.036                         | 0  | 97.702                          | 7.090   | -775                        |
| GC FTPYME PASTOR 4, FTA                                      | FTA  | BONOS               | 82.858                         | 4.113                                    | 82.296                          | 0       | -2.320                      |
| GC FTPYME SABADELL 4, FTA                                    | FTA  | BONOS               | 108.106                        | 0  | 111.271                         | 3.629   | -1.727                      |
| GC FTPYME SABADELL 5, FTA                                    | FTA  | BONOS               | 211.238                        | 0  | 231.012                         | 8.193   | -4.042                      |
| GC FTPYME SABADELL 6, FTA                                    | FTA  | BONOS               | 239.548                        | 0  | 258.867                         | 4.074   | -5.283                      |
| GC FTPYME SABADELL 8, FTA                                    | FTA  | BONOS               | 514.661                        | 0  | 557.560                         | 81.231  | 42                          |
| GC FTPYME UNNIM 1, FTA                                       | FTA  | BONOS               | 210.769                        | 0  | 219.506                         | 36.422  | 3.533                       |
| GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA                                 | FTA  | BONOS               | 391.093                        | 6.196                                    | 401.787                         | 1       | -44.048                     |
| GC SABADELL EMPRESAS 2, FTA                                  | FTA  | BONOS               | 248.965                        | 0  | 254.596                         | 12.921  | -2.050                      |
| GC SABADELL EMPRESAS 4, FTA                                  | FTA  | BONOS               | 229.634                        | 0  | 236.356                         | 59.405  | 330                         |
| HIPOCAT 10, FTA  | FTA  | BONOS               | 672.105                        | 9.436                                    | 690.163                         | 0       | -25.923                     |
| HIPOCAT 11, FTA  | FTA  | BONOS               | 684.882                        | 13.032                                   | 706.592                         | 0       | -26.220                     |
| HIPOCAT 14, FTA  | FTA  | BONOS               | 394.452                        | 560                                      | 403.677                         | 169     | -11.486                     |
| HIPOCAT 16, FTA  | FTA  | BONOS               | 613.011                        | 0  | 616.395                         | 17.289  | -5.703                      |

| FONDO                                 | TIPO |       | ACTIVO              |                                | PASIVO                                   |                                 | DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO) |
|---------------------------------------|------|-------|---------------------|--------------------------------|--|---------------------------------|-----------------------------|
|                                       |      |       | DERECHOS DE CRÉDITO | ACTIVOS NO CORRIENTES EN VENTA | OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES | DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO |                             |
| HIPOCAT 17, FTA                       | FTA  | BONOS | 782.863             | 1.472                          | 670.196                                  | 139.519                         | -7.973                      |
| HIPOCAT 18, FTA                       | FTA  | BONOS | 611.685             | 167                            | 619.271                                  | 57.473                          | 0                           |
| HIPOCAT 19, FTA                       | FTA  | BONOS | 604.979             | 1.327                          | 380.884                                  | 246.507                         | 0                           |
| HIPOCAT 20, FTA                       | FTA  | BONOS | 763.982             | 49                             | 502.476                                  | 329.060                         | 0                           |
| HIPOCAT 4, FTA                        | FTA  | BONOS | 54.839              | 0                              | 54.922                                   | 0                               | -1.108                      |
| HIPOCAT 5, FTA                        | FTA  | BONOS | 142.440             | 0                              | 144.800                                  | 6.927                           | -5.084                      |
| HIPOCAT 6, FTA                        | FTA  | BONOS | 220.590             | 141                            | 207.871                                  | 17.029                          | -9.199                      |
| HIPOCAT 7, FTA                        | FTA  | BONOS | 453.694             | 1.421                          | 455.686                                  | 19.995                          | -23.176                     |
| HIPOCAT 8, FTA                        | FTA  | BONOS | 568.804             | 1.935                          | 563.142                                  | 16.576                          | -27.889                     |
| HIPOCAT 9, FTA                        | FTA  | BONOS | 434.676             | 3.462                          | 457.616                                  | 0                               | -14.329                     |
| ICO MEDIACION I AYT, FTA              | FTA  | BONOS | 535.932             | 0                              | 363.793                                  | 249.716                         | -2.214                      |
| ICO MEDIACION II AYT FTA              | FTA  | BONOS | 10.535.838          | 0                              | 3.595.362                                | 13.016.523                      | -42.210                     |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 1, FTA        | FTA  | BONOS | 185.010             | 0                              | 181.706                                  | 12.605                          | -12.676                     |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 2, FTA        | FTA  | BONOS | 381.535             | 0                              | 376.502                                  | 88.236                          | -32.032                     |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 3, FTA        | FTA  | BONOS | 899.822             | 0                              | 918.581                                  | 182.621                         | 0                           |
| IM BANCO POPULAR MBS 2, FTA           | FTA  | BONOS | 579.147             | 0                              | 573.788                                  | 57.458                          | -40.303                     |
| IM BANKOA MBS 1, FTA                  | FTA  | BONOS | 391.120             | 0                              | 393.475                                  | 27.014                          | -1.422                      |
| IM BCG RMBS 1, FTA                    | FTA  | BONOS | 328.845             | 0                              | 330.951                                  | 25.571                          | -1.587                      |
| IM BES EMPRESAS 1, FTA                | FTA  | BONOS | 360.396             | 0                              | 372.745                                  | 22.184                          | 0                           |
| IM CAJA LABORAL 1, FTA                | FTA  | BONOS | 442.288             | 0                              | 466.130                                  | 0                               | -9.765                      |
| IM CAJA LABORAL 2, FTA                | FTA  | BONOS | 480.996             | 0                              | 482.286                                  | 29.307                          | -14.002                     |
| IM CAJA LABORAL EMPRESAS 1, FTA       | FTA  | BONOS | 325.793             | 0                              | 194.219                                  | 164.310                         | 0                           |
| IM CAJAMAR 1, FTA                     | FTA  | BONOS | 120.585             | 0                              | 122.019                                  | 2.222                           | -4.266                      |
| IM CAJAMAR 3, FTA                     | FTA  | BONOS | 580.616             | 0                              | 571.640                                  | 5.568                           | -39.205                     |
| IM CAJAMAR 4, FTA                     | FTA  | BONOS | 564.277             | 0                              | 567.457                                  | 0                               | -40.185                     |
| IM CAJAMAR 5, FTA                     | FTA  | BONOS | 664.707             | 0                              | 664.344                                  | 2.270                           | -47.823                     |
| IM CAJAMAR 6, FTA                     | FTA  | BONOS | 1.410.746           | 0                              | 1.420.093                                | 9.646                           | -114.750                    |
| IM CAJAMAR EMPRESAS 2 FTPYME, FTA     | FTA  | BONOS | 148.982             | 0                              | 149.439                                  | 38.882                          | -6.032                      |
| IM CAJAMAR EMPRESAS 4, FTA            | FTA  | BONOS | 864.952             | 0                              | 954.788                                  | 569                             | 0                           |
| IM CAJASTUR MBS 1, FTA                | FTA  | BONOS | 542.045             | 0                              | 544.121                                  | 95.054                          | -13.282                     |
| IM CEDULAS 1 GRUPO BANCO POPULAR, FTA | FTA  | BONOS | 2.075.234           | 0                              | 2.075.083                                | 171.202                         | 0                           |
| IM CEDULAS 10, FTA                    | FTA  | BONOS | 1.350.324           | 0                              | 1.350.213                                | 0                               | 0                           |
| IM CEDULAS 14, FTA                    | FTA  | BONOS | 1.229.340           | 0                              | 1.229.250                                | 62.404                          | 0                           |
| IM CEDULAS 15, FTA                    | FTA  | BONOS | 800.772             | 0                              | 800.770                                  | 66.698                          | 0                           |

| FONDO                                  | TIPO |       | ACTIVO              |                                | PASIVO                                   |                                 | DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO) |
|--|------|-------|---------------------|--------------------------------|--|---------------------------------|-----------------------------|
|  |      |       | DERECHOS DE CRÉDITO | ACTIVOS NO CORRIENTES EN VENTA | OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES | DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO |                             |
| IM CEDULAS 2, FTA                      | FTA  | BONOS | 1.511.772           | 0                              | 1.511.691                                | 0                               | 0                           |
| IM CEDULAS 3, FTA                      | FTA  | BONOS | 1.064.841           | 0                              | 1.064.829                                | 0                               | 0                           |
| IM CEDULAS 4, FTA                      | FTA  | BONOS | 2.137.849           | 0                              | 2.137.682                                | 0                               | 0                           |
| IM CEDULAS 5, FTA                      | FTA  | BONOS | 1.273.766           | 0                              | 1.273.698                                | 0                               | 0                           |
| IM CEDULAS 7, FTA                      | FTA  | BONOS | 1.287.733           | 0                              | 1.287.639                                | 0                               | 0                           |
| IM CEDULAS 9, FTA                      | FTA  | BONOS | 1.305.326           | 0                              | 1.305.255                                | 0                               | 0                           |
| IM CFS RMBS 1, FTA                     | FTA  | BONOS | 378.248             | 0                              | 283.530                                  | 106.252                         | 0                           |
| IM CITI TARJETAS 1, FTA                | FTA  | BONOS | 1.045.284           | 0                              | 1.002.640                                | 193.495                         | 0                           |
| IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA            | FTA  | BONOS | 165.178             | 0                              | 176.172                                  | 4.758                           | -8.052                      |
| IM FTGENCAT SABADELL 3, FTA            | FTA  | BONOS | 84.752              | 0                              | 86.802                                   | 6.221                           | -3.487                      |
| IM FTGENCAT SABADELL 4, FTA            | FTA  | BONOS | 151.505             | 0                              | 164.023                                  | 24.941                          | -6.120                      |
| IM FTPYME SABADELL 3, FTA              | FTA  | BONOS | 56.583              | 0                              | 61.848                                   | 9.591                           | -660                        |
| IM FTPYME SABADELL 7, FTA              | FTA  | BONOS | 324.597             | 0                              | 330.472                                  | 47.169                          | -2.626                      |
| IM FTPYME SABADELL 9, FTA              | FTA  | BONOS | 1.082.803           | 0                              | 1.178.200                                | 127.086                         | 0                           |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, FTA | FTA  | BONOS | 303.769             | 0                              | 319.749                                  | 6.968                           | -1.427                      |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 3, FTA | FTA  | BONOS | 707.653             | 0                              | 2.277.620                                | 181.908                         | 47.778                      |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 4, FTA | FTA  | BONOS | 1.049.920           | 0                              | 1.133.353                                | 404.324                         | 0                           |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I FTA    | FTA  | BONOS | 424.311             | 0                              | 429.040                                  | 6.355                           | -1.610                      |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME II, FTA  | FTA  | BONOS | 277.429             | 0                              | 322.634                                  | 714                             | -7.879                      |
| IM GRUPO BANCO POPULAR LEASING 2, FTA  | FTA  | BONOS | 740.751             | 0                              | 783.473                                  | 295.819                         | 0                           |
| IM PASTOR 4, FTA                       | FTA  | BONOS | 417.910             | 18.922                         | 424.160                                  | 6.944                           | -27.137                     |
| IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, FTA       | FTA  | BONOS | 180.107             | 0                              | 180.416                                  | 0                               | -7.843                      |
| IM SABADELL EMPRESAS 1, FTA            | FTA  | BONOS | 176.788             | 0                              | 188.574                                  | 7.886                           | -1.636                      |
| IM SABADELL EMPRESAS 3, FTA            | FTA  | BONOS | 572.349             | 0                              | 615.080                                  | 259.026                         | -17.046                     |
| IM SABADELL EMPRESAS 5, FTA            | FTA  | BONOS | 215.852             | 0                              | 235.324                                  | 77.050                          | -4.692                      |
| IM SABADELL RMBS 2, FTA                | FTA  | BONOS | 838.871             | 0                              | 855.796                                  | 16.950                          | -53.336                     |
| IM SABADELL RMBS 3, FTA                | FTA  | BONOS | 937.537             | 0                              | 936.540                                  | 42.600                          | -105.673                    |
| IM TERRASSA 1 FTGENCAT FTA             | FTA  | BONOS | 48.458              | 0                              | 48.567                                   | 9.009                           | -853                        |
| IM TERRASSA MBS 1, FTA                 | FTA  | BONOS | 213.527             | 0                              | 220.156                                  | 0                               | -10.924                     |
| INTERMONEY MASTER CEDULAS, FTA         | FTA  | BONOS | 1.659.680           | 0                              | 1.659.666                                | 0                               | 0                           |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS III, FTA   | FTA  | BONOS | 622.709             | 0                              | 257.682                                  | 516.983                         | 3.130                       |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS IV, FTA    | FTA  | BONOS | 632.941             | 0                              | 287.288                                  | 535.498                         | -22.870                     |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS V, FTA     | FTA  | BONOS | 1.081.695           | 0                              | 586.285                                  | 561.473                         | -127.058                    |
| MADRID CONSUMO I, FTA                  | FTA  | BONOS | 139.424             | 0                              | 96.855                                   | 90.216                          | -3.111                      |

| FONDO                           | TIPO |       | ACTIVO              |                                | PASIVO                                   |                                 | DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO) |
|---------------------------------|------|-------|---------------------|--------------------------------|--|---------------------------------|-----------------------------|
|                                 |      |       | DERECHOS DE CRÉDITO | ACTIVOS NO CORRIENTES EN VENTA | OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES | DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO |                             |
| MADRID FTPYME I, FTA            | FTA  | BONOS | 620.773             | 223                            | 377.315                                  | 444.170                         | 31.867                      |
| MADRID FTPYME II, FTA           | FTA  | BONOS | 653.402             | 0                              | 321.998                                  | 414.644                         | -1.110                      |
| MADRID ICO-FTVPO I, FTA         | FTA  | BONOS | 190.086             | 829                            | 158.360                                  | 51.639                          | -1.985                      |
| MADRID RESIDENCIAL I, FTA       | FTA  | BONOS | 584.694             | 4.379                          | 388.120                                  | 282.615                         | -5.234                      |
| MADRID RESIDENCIAL II, FTA      | FTA  | BONOS | 524.084             | 1.149                          | 382.964                                  | 205.329                         | -1.239                      |
| MADRID RMBS I, FTA              | FTA  | BONOS | 994.516             | 31.535                         | 969.741                                  | 74.350                          | -19.268                     |
| MADRID RMBS II, FTA             | FTA  | BONOS | 886.581             | 32.561                         | 855.009                                  | 72.451                          | -16.857                     |
| MADRID RMBS III, FTA            | FTA  | BONOS | 1.662.981           | 64.235                         | 1.638.565                                | 110.319                         | -11.350                     |
| MADRID RMBS IV, FTA             | FTA  | BONOS | 1.301.816           | 57.380                         | 1.286.456                                | 196.064                         | -12.156                     |
| MBS BANCAJA 1, FTA              | FTA  | BONOS | 110.941             | 0                              | 112.045                                  | 7.040                           | -2.650                      |
| MBS BANCAJA 2, FTA              | FTA  | BONOS | 248.186             | 0                              | 256.734                                  | 0                               | -3.767                      |
| MBS BANCAJA 3, FTA              | FTA  | BONOS | 339.136             | 0                              | 344.218                                  | 0                               | -6.779                      |
| MBS BANCAJA 4, FTA              | FTA  | BONOS | 965.612             | 0                              | 989.862                                  | 1.384                           | -18.979                     |
| MBS BANCAJA 6, FTA              | FTA  | BONOS | 750.158             | 0                              | 753.714                                  | 73.149                          | 0                           |
| MBS BANCAJA 7, FTA              | FTA  | BONOS | 778.494             | 0                              | 782.482                                  | 44.809                          | 0                           |
| MBS BANCAJA 8, FTA              | FTA  | BONOS | 409.266             | 0                              | 406.914                                  | 23.341                          | 0                           |
| MBSCAT 1, FTA                   | FTA  | BONOS | 682.314             | 1.368                          | 573.017                                  | 154.042                         | -29.691                     |
| MBSCAT 2, FTA                   | FTA  | BONOS | 318.085             | 143                            | 113.399                                  | 225.430                         | 0                           |
| PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA       | FTA  | BONOS | 10.398.710          | 0                              | 10.398.710                               | 300.513                         | 0                           |
| PYME BANCAJA 5, FTA             | FTA  | BONOS | 123.624             | 3.918                          | 140.029                                  | 0                               | -1.814                      |
| PYME BANCAJA 7, FTA             | FTA  | BONOS | 373.939             | 0                              | 339.999                                  | 221.084                         | -5.264                      |
| PYME VALENCIA 1, FTA            | FTA  | BONOS | 178.404             | 6.971                          | 187.655                                  | 0                               | -5.357                      |
| PYME VALENCIA 2, FTA            | FTA  | BONOS | 180.584             | 1.955                          | 178.527                                  | 90.126                          | 0                           |
| PYMECAT 2 FTPYME, FTA           | FTA  | BONOS | 132.733             | 1.245                          | 141.503                                  | 5.234                           | -20                         |
| PYMECAT 3 FTPYME, FTA           | FTA  | BONOS | 320.707             | 0                              | 85.247                                   | 279.582                         | 0                           |
| PYMES BANESTO 2, FTA            | FTA  | BONOS | 229.760             | 9.832                          | 228.297                                  | 14.367                          | -5.323                      |
| RURAL CEDULA I, FTA             | FTA  | BONOS | 1.032.292           | 0                              | 1.031.885                                | 86.573                          | 0                           |
| RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA | FTA  | BONOS | 431.037             | 1.755                          | 450.716                                  | 0                               | -21.037                     |
| RURAL HIPOTECARIO IX, FTA       | FTA  | BONOS | 873.062             | 9.687                          | 886.050                                  | 1.204                           | -34.234                     |
| RURAL HIPOTECARIO V, FTA        | FTA  | BONOS | 184.819             | 145                            | 185.571                                  | 8.539                           | 0                           |
| RURAL HIPOTECARIO VI, FTA       | FTA  | BONOS | 306.478             | 103                            | 313.518                                  | 7.369                           | -12.552                     |
| RURAL HIPOTECARIO VII, FTA      | FTA  | BONOS | 411.650             | 795                            | 414.942                                  | 9.651                           | -18.259                     |
| RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA     | FTA  | BONOS | 629.474             | 2.104                          | 651.122                                  | 0                               | -24.769                     |
| RURAL HIPOTECARIO X, FTA        | FTA  | BONOS | 1.274.302           | 4.849                          | 1.281.904                                | 49.522                          | -47.801                     |

| FONDO                                     | TIPO |       | ACTIVO              |                                | PASIVO                                   |                                 | DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO) |
|---|------|-------|---------------------|--------------------------------|--|---------------------------------|-----------------------------|
|   |      |       | DERECHOS DE CRÉDITO | ACTIVOS NO CORRIENTES EN VENTA | OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES | DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO |                             |
| RURAL HIPOTECARIO XI, FTA                 | FTA  | BONOS | 1.618.569           | 4.140                          | 1.619.688                                | 96.922                          | -53.673                     |
| RURAL HIPOTECARIO XII, FTA                | FTA  | BONOS | 740.491             | 533                            | 741.089                                  | 54.981                          | -21.252                     |
| RURALPYME 1 FTPYME FTA                    | FTA  | BONOS | 22.436              | 115                            | 22.458                                   | 9.129                           | -720                        |
| RURALPYME 2 FTPYME FTA                    | FTA  | BONOS | 128.863             | 380                            | 159.574                                  | 2.774                           | -3.216                      |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN 09-1, FTA        | FTA  | BONOS | 147.137             | 0                              | 243.180                                  | 0                               | -8.006                      |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2010-1, FTA | FTA  | BONOS | 249.964             | 0                              | 356.692                                  | 0                               | -15.940                     |
| SANTANDER HIPOTECARIO I, FTA              | FTA  | BONOS | 591.091             | 1.528                          | 604.447                                  | 18.792                          | -3.068                      |
| SOL-LION, FTA                             | FTA  | BONOS | 3.215.327           | 0                              | 3.267.336                                | 82.165                          | 141.904                     |
| TDA 13 - MIXTO, FTA                       | FTA  | BONOS | 50.747              | 0                              | 52.634                                   | 3.952                           | 0                           |
| TDA 14 - MIXTO, FTA                       | FTA  | BONOS | 98.842              | 0                              | 102.575                                  | 7.380                           | 0                           |
| TDA 15 - MIXTO, FTA                       | FTA  | BONOS | 103.925             | 0                              | 104.294                                  | 5.504                           | 0                           |
| TDA 16 - MIXTO, FTA                       | FTA  | BONOS | 109.307             | 337                            | 107.304                                  | 8.974                           | 0                           |
| TDA 17 - MIXTO, FTA                       | FTA  | BONOS | 86.082              | 0                              | 85.555                                   | 9.642                           | 0                           |
| TDA 18 - MIXTO, FTA                       | FTA  | BONOS | 110.544             | 0                              | 110.259                                  | 7.656                           | 0                           |
| TDA 19 - MIXTO, FTA                       | FTA  | BONOS | 176.512             | 0                              | 175.697                                  | 11.696                          | -2.869                      |
| TDA 20 - MIXTO, FTA                       | FTA  | BONOS | 130.906             | 0                              | 134.832                                  | 8.478                           | -1.359                      |
| TDA 22 - MIXTO, FTA                       | FTA  | BONOS | 175.276             | 1.599                          | 165.928                                  | 6.429                           | -2.495                      |
| TDA 23, FTA                               | FTA  | BONOS | 298.658             | 0                              | 288.975                                  | 11.539                          | -2.151                      |
| TDA 24, FTA                               | FTA  | BONOS | 212.796             | 2.494                          | 209.837                                  | 1.675                           | -1.569                      |
| TDA 25, FTA                               | FTA  | BONOS | 139.408             | 8.267                          | 148.081                                  | 697                             | -1.442                      |
| TDA 26 - MIXTO, FTA                       | FTA  | BONOS | 360.182             | 0                              | 370.627                                  | 53                              | -1.733                      |
| TDA 27, FTA                               | FTA  | BONOS | 509.097             | 6.631                          | 507.077                                  | 15.733                          | -7.928                      |
| TDA 28, FTA                               | FTA  | BONOS | 296.485             | 9.138                          | 308.077                                  | 4.870                           | -3.848                      |
| TDA 29, FTA                               | FTA  | BONOS | 454.548             | 0                              | 453.547                                  | 372                             | 6.538                       |
| TDA 30, FTA                               | FTA  | BONOS | 260.911             | 0                              | 267.223                                  | 15                              | 9.818                       |
| TDA 31, FTA                               | FTA  | BONOS | 180.093             | 0                              | 176.749                                  | 6.211                           | 5.614                       |
| TDA CAJAMAR 2, FTA                        | FTA  | BONOS | 381.023             | 0                              | 375.309                                  | 3.400                           | -12.021                     |
| TDA CAM 1, FTA                            | FTA  | BONOS | 223.591             | 0                              | 224.503                                  | 10.537                          | -2.777                      |
| TDA CAM 10, FTA                           | FTA  | BONOS | 744.121             | 0                              | 732.908                                  | 5.080                           | -1.418                      |
| TDA CAM 11, FTA                           | FTA  | BONOS | 1.199.286           | 0                              | 1.232.916                                | 22.652                          | 32.253                      |
| TDA CAM 12, FTA                           | FTA  | BONOS | 1.406.892           | 0                              | 1.457.906                                | 4.503                           | 37.562                      |
| TDA CAM 2, FTA                            | FTA  | BONOS | 253.956             | 0                              | 258.616                                  | 8.605                           | -3.937                      |
| TDA CAM 3, FTA                            | FTA  | BONOS | 281.720             | 0                              | 289.032                                  | 9.020                           | -3.625                      |
| TDA CAM 4, FTA                            | FTA  | BONOS | 686.128             | 0                              | 678.372                                  | 20.150                          | -14.910                     |

| FONDO                                   | TIPO | ACTIVO              |                                |                  | PASIVO                                   |                                 | DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO) |
|---|------|---------------------|--------------------------------|------------------|--|---------------------------------|-----------------------------|
|   |      | DERECHOS DE CRÉDITO | ACTIVOS NO CORRIENTES EN VENTA |                  | OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES | DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO |                             |
| TDA CAM 5, FTA                          | FTA  | BONOS               | 929.085                        | 0                | 919.245                                  | 21.468                          | -25.613                     |
| TDA CAM 6, FTA                          | FTA  | BONOS               | 626.576                        | 0                | 611.162                                  | 16.842                          | -12.852                     |
| TDA CAM 7, FTA                          | FTA  | BONOS               | 939.929                        | 0                | 908.068                                  | 29.032                          | -13.649                     |
| TDA CAM 8, FTA                          | FTA  | BONOS               | 941.364                        | 0                | 934.570                                  | 6.744                           | -14.853                     |
| TDA CAM 9, FTA                          | FTA  | BONOS               | 859.918                        | 0                | 857.440                                  | 6.852                           | -11.261                     |
| TDA CORPORATIVOS I, FTA                 | FTA  | BONOS               | 296.683                        | 0                | 312.903                                  | 347.582                         | 345                         |
| TDA EMPRESAS 1, FTA                     | FTA  | BONOS               | 49.582                         | 0                | 52.131                                   | 9.300                           | 0                           |
| TDA EMPRESAS 2, FTA                     | FTA  | BONOS               | 50.756                         | 0                | 64.633                                   | 46.370                          | 0                           |
| TDA FTPYME PASTOR 9, FTA                | FTA  | BONOS               | 246.546                        | 0                | 267.637                                  | 70.926                          | 0                           |
| TDA IBERCAJA 1, FTA                     | FTA  | BONOS               | 165.718                        | 0                | 172.205                                  | 4.209                           | -2.647                      |
| TDA IBERCAJA 2, FTA                     | FTA  | BONOS               | 395.332                        | 0                | 410.797                                  | 0                               | -5.125                      |
| TDA IBERCAJA 3, FTA                     | FTA  | BONOS               | 488.497                        | 0                | 499.354                                  | 0                               | -5.603                      |
| TDA IBERCAJA 4, FTA                     | FTA  | BONOS               | 726.015                        | 0                | 748.775                                  | 0                               | -8.181                      |
| TDA IBERCAJA 5, FTA                     | FTA  | BONOS               | 706.896                        | 0                | 724.318                                  | 0                               | -7.276                      |
| TDA IBERCAJA 6, FTA                     | FTA  | BONOS               | 1.025.657                      | 0                | 1.059.621                                | 19.429                          | -13.746                     |
| TDA IBERCAJA 7, FTA                     | FTA  | BONOS               | 1.664.469                      | 0                | 1.757.476                                | 0                               | 5.328                       |
| TDA LICO LEASING III, FTA               | FTA  | BONOS               | 123.709                        | 0                | 78.433                                   | 64.022                          | 0                           |
| TDA PASTOR 1, FTA                       | FTA  | BONOS               | 97.466                         | 0                | 95.153                                   | 1.978                           | -771                        |
| TDA PASTOR CONSUMO 1, FTA               | FTA  | BONOS               | 26.406                         | 0                | 30.301                                   | 766                             | -698                        |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA           | FTA  | BONOS               | 57.732                         | 0                | 58.785                                   | 15.369                          | -439                        |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA           | FTA  | BONOS               | 127.893                        | 0                | 128.951                                  | 39.224                          | -1.013                      |
| TDA TARRAGONA 1, FTA                    | FTA  | BONOS               | 269.999                        | 0                | 274.084                                  | 539                             | -7.094                      |
| UNICAJA ANDALUCIA FTVIVIENDA TDA 1, FTA | FTA  | BONOS               | 148.905                        | 0                | 152.216                                  | 15.789                          | 4.278                       |
| UNICAJA AYT EMPRESAS I, FTA             | FTA  | BONOS               | 116.884                        | 0                | 121.835                                  | 24.186                          | 4.669                       |
| UNICAJA TDA VPO, FTA                    | FTA  | BONOS               | 150.201                        | 0                | 152.022                                  | 9.684                           | -9.120                      |
| VAL BANCAJA 1, FTA                      | FTA  | BONOS               | 251.585                        | 0                | 249.964                                  | 30.571                          | 0                           |
| VALENCIA HIPOTECARIO 1, FTA             | FTA  | BONOS               | 128.667                        | 29               | 131.109                                  | 4.733                           | -3.789                      |
| VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA             | FTA  | BONOS               | 476.080                        | 5.342            | 482.383                                  | 562                             | -7.898                      |
| VALENCIA HIPOTECARIO 4, FTA             | FTA  | BONOS               | 616.611                        | 31.484           | 664.044                                  | 0                               | -11.762                     |
| VALENCIA HIPOTECARIO 5, FTA             | FTA  | BONOS               | 381.435                        | 8.627            | 381.611                                  | 34.574                          | -5.132                      |
| <b>Subtotal FTA/BONOS 2012 2</b>        |      |                     | <b>308.597.128</b>             | <b>1.007.008</b> | <b>310.467.168</b>                       | <b>35.275.856</b>               | <b>-2.980.615</b>           |
| <b>Subtotal FTA/BONOS 2011 2</b>        |      |                     | <b>394.829.412</b>             | <b>1.017.360</b> | <b>399.249.595</b>                       | <b>36.239.603</b>               | <b>-3.876.153</b>           |
| <b>%Variación</b>                       |      |                     | <b>-21,84</b>                  | <b>-1,02</b>     | <b>-22,24</b>                            | <b>-2,66</b>                    | <b>-23,10</b>               |

| FONDO                              | TIPO |         | ACTIVO              |                                | PASIVO                                   |                                 | DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO) |
|------------------------------------|------|---------|---------------------|--------------------------------|--|---------------------------------|-----------------------------|
|                                    |      |         | DERECHOS DE CRÉDITO | ACTIVOS NO CORRIENTES EN VENTA | OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES | DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO |                             |
| FTA SANTANDER 2                    | FTA  | PAGARÉS | 1.300.714           | 658                            | 1.349.085                                | 228.607                         | 0                           |
| <b>Subtotal FTA/PAGARÉS 2012 2</b> |      |         | <b>1.300.714</b>    | <b>658</b>                     | <b>1.349.085</b>                         | <b>228.607</b>                  | <b>0</b>                    |
| <b>Subtotal FTA/PAGARÉS 2011 2</b> |      |         | <b>1.533.715</b>    | <b>0</b>                       | <b>1.595.680</b>                         | <b>78.149</b>                   | <b>0</b>                    |
| <b>%Variación</b>                  |      |         | <b>-15,19</b>       | <b>-</b>                       | <b>-15,45</b>                            | <b>192,53</b>                   | <b>-</b>                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO II, FTH     | FTH  | BONOS   | 232.554             | 104                            | 235.561                                  | 8.086                           | -4.130                      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO III, FTH    | FTH  | BONOS   | 256.519             | 0                              | 265.820                                  | 9.340                           | -4.685                      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, FTH     | FTH  | BONOS   | 289.331             | 206                            | 297.120                                  | 10.045                          | -4.145                      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH     | FTH  | BONOS   | 578.727             | 852                            | 592.010                                  | 11.583                          | -10.480                     |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH     | FTH  | BONOS   | 307.470             | 205                            | 316.940                                  | 5.871                           | -5.647                      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH    | FTH  | BONOS   | 687.117             | 1.516                          | 696.561                                  | 16.805                          | -3.971                      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH   | FTH  | BONOS   | 1.026.819           | 728                            | 1.048.421                                | 17.269                          | -57.344                     |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH      | FTH  | BONOS   | 665.197             | 962                            | 670.954                                  | 9.987                           | -11.101                     |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH     | FTH  | BONOS   | 792.874             | 1.710                          | 803.793                                  | 35.564                          | -36.973                     |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH    | FTH  | BONOS   | 560.134             | 282                            | 564.143                                  | 25.718                          | -27.430                     |
| AYT HIPOTECARIO III, FTH           | FTH  | BONOS   | 78.883              | 0                              | 79.738                                   | 3.853                           | 0                           |
| AYT HIPOTECARIO IV, FTH            | FTH  | BONOS   | 69.662              | 0                              | 70.666                                   | 3.502                           | -568                        |
| AYT.1, FTH                         | FTH  | BONOS   | 30.330              | 0                              | 30.757                                   | 4.754                           | 0                           |
| AYT.11, FTH                        | FTH  | BONOS   | 82.732              | 178                            | 85.936                                   | 4.161                           | -355                        |
| AYT.2, FTH                         | FTH  | BONOS   | 15.454              | 0                              | 15.631                                   | 2.330                           | 0                           |
| BANCAJA 4, FTH                     | FTH  | BONOS   | 176.049             | 0                              | 177.677                                  | 4.002                           | -4.756                      |
| BANKINTER 11, FTH                  | FTH  | BONOS   | 446.565             | 178                            | 466.317                                  | 0                               | -8.523                      |
| BANKINTER 12, FTH                  | FTH  | BONOS   | 607.710             | 1.229                          | 620.094                                  | 0                               | -11.177                     |
| BANKINTER 2, FTH                   | FTH  | BONOS   | 33.936              | 0                              | 37.765                                   | 0                               | 0                           |
| BANKINTER 3, FTH                   | FTH  | BONOS   | 229.736             | 73                             | 239.782                                  | 13.273                          | -4.365                      |
| BANKINTER 4, FTH                   | FTH  | BONOS   | 241.565             | 0                              | 248.680                                  | 5.228                           | -4.438                      |
| BANKINTER 5, FTH                   | FTH  | BONOS   | 170.066             | 52                             | 174.878                                  | 4.267                           | -3.266                      |
| BANKINTER 7, FTH                   | FTH  | BONOS   | 153.300             | 47                             | 154.253                                  | 4.902                           | -2.631                      |
| FTH UCI 10                         | FTH  | BONOS   | 173.306             | 590                            | 172.076                                  | 6.116                           | 0                           |
| FTH UCI 12                         | FTH  | BONOS   | 349.104             | 4.991                          | 341.704                                  | 10.353                          | 0                           |
| FTH UCI 5                          | FTH  | BONOS   | 22.432              | 22                             | 22.725                                   | 2.658                           | 0                           |
| GAT ICO-FTVPO 1, FTH               | FTH  | BONOS   | 247.628             | 0                              | 259.775                                  | 7.123                           | -8.692                      |
| GC SABADELL 1, FTH                 | FTH  | BONOS   | 351.829             | 0                              | 356.962                                  | 6.637                           | -8.168                      |
| IM PASTOR 2, FTH                   | FTH  | BONOS   | 261.239             | 767                            | 264.658                                  | 5.000                           | -8.598                      |
| IM PASTOR 3, FTH                   | FTH  | BONOS   | 330.462             | 18.864                         | 348.052                                  | 4.619                           | -20.853                     |



| FONDO                       | TIPO | ACTIVO              |                                |                  | PASIVO                                   |                                 | DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO) |
|-----------------------------|------|---------------------|--------------------------------|------------------|--|---------------------------------|-----------------------------|
|                             |      | DERECHOS DE CRÉDITO | ACTIVOS NO CORRIENTES EN VENTA |                  | OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES | DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO |                             |
| RURAL HIPOTECARIO II FTH    | FTH  | BONOS               | 22.358                         | 0                | 23.525                                   | 2.354                           | 0                           |
| RURAL HIPOTECARIO III FTH   | FTH  | BONOS               | 52.074                         | 0                | 53.017                                   | 3.264                           | 0                           |
| RURAL HIPOTECARIO IV FTH    | FTH  | BONOS               | 101.692                        | 25               | 104.388                                  | 5.798                           | 0                           |
| TDA 11, FTH                 | FTH  | BONOS               | 52.893                         | 0                | 55.480                                   | 6.658                           | 0                           |
| TDA 12, FTH                 | FTH  | BONOS               | 49.528                         | 0                | 52.026                                   | 5.173                           | 0                           |
| TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH | FTH  | BONOS               | 309.657                        | 0                | 353.438                                  | 895                             | -20.774                     |
| VALENCIA HIPOTECARIO 2, FTH | FTH  | BONOS               | 391.379                        | 5.896            | 409.278                                  | 0                               | -7.618                      |
| <b>Subtotal FTH 2012 2</b>  |      |                     | <b>10.448.311</b>              | <b>39.477</b>    | <b>10.710.601</b>                        | <b>267.188</b>                  | <b>-280.688</b>             |
| <b>Subtotal FTH 2011 2</b>  |      |                     | <b>15.835.844</b>              | <b>33.723</b>    | <b>16.226.097</b>                        | <b>318.398</b>                  | <b>-358.206</b>             |
| <b>%Variación</b>           |      |                     | <b>-34,02</b>                  | <b>17,06</b>     | <b>-33,99</b>                            | <b>-16,08</b>                   | <b>-21,64</b>               |
| <b>Total 2012 2</b>         |      |                     | <b>320.346.153</b>             | <b>1.047.143</b> | <b>322.526.854</b>                       | <b>35.771.651</b>               | <b>-3.261.303</b>           |
| <b>Total 2011 2</b>         |      |                     | <b>412.198.971</b>             | <b>1.051.083</b> | <b>417.071.372</b>                       | <b>36.636.150</b>               | <b>-4.234.359</b>           |
| <b>%Variación</b>           |      |                     | <b>-22,28</b>                  | <b>-0,37</b>     | <b>-22,67</b>                            | <b>-2,36</b>                    | <b>-22,98</b>               |

Nota: Importes en miles de euros

| FONDO                                   | DEUDA SUBORDINADA Y BONOS TESORERÍA |          |                   | AAPP | CONSUMO Y AUTOMOCIÓN | CUENTAS A COBRAR | DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS |                       |       | BONOS DE TITULIZACIÓN | OTROS   | DUDOSOS - DETERIORO | INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES (1) |
|---|-------------------------------------|----------|-------------------|------|----------------------|------------------|-----------------------------|-----------------------|-------|-----------------------|---------|---------------------|------------------------------------|
|   | HIPOTECARIOS                        | EMPRESAS | Y BONOS TESORERÍA |      |                      |                  | CRÉDITO FUTUROS             | BONOS DE TITULIZACIÓN | OTROS |                       |         |                     |                                    |
| <b>BONOS</b>                            |                                     |          |                   |      |                      |                  |                             |                       |       |                       |         |                     |                                    |
| AUTO ABS 2012-3, FTA                    | 0                                   | 0        | 0                 | 0    | 770.259              | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 1       | 4.512               |                                    |
| AYT ANDALUCIA FTEMPRESA CAJAMAR, FTA    | 0                                   | 142.085  | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 9.504   | 553                 |                                    |
| AYT CAIXA GALICIA EMPRESAS I, FTA       | 0                                   | 207.512  | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 11.101  | 701                 |                                    |
| AYT CAIXA SABADELL HIPOTECARIO I, FTA   | 212.194                             | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 25.746  | 409                 |                                    |
| AYT CAIXANOVA FTPYME I, FTA             | 0                                   | 45.894   | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 2.773   | 214                 |                                    |
| AYT CAIXANOVA HIPOTECARIO I, FTA        | 158.560                             | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 9.356   | 906                 |                                    |
| AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA              | 858.396                             | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 424     | 1.172               |                                    |
| AYT CAJA MURCIA HIPOTECARIO I, FTA      | 120.030                             | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 1.600   | 249                 |                                    |
| AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA      | 180.622                             | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 14.397  | 326                 |                                    |
| AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FTA      | 132.167                             | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 802     | 271                 |                                    |
| AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA            | 36.708.689                          | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 0       | 480.910             |                                    |
| AYT CEDULAS CAJAS IV, FTA               | 3.800.000                           | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 0       | 123.485             |                                    |
| AYT CEDULAS CAJAS IX, FTA               | 5.000.000                           | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 0       | 145.775             |                                    |
| AYT CEDULAS CAJAS V, FTA                | 3.100.000                           | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 0       | 11.915              |                                    |
| AYT CEDULAS CAJAS VI, FTA               | 3.300.000                           | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 0       | 98.138              |                                    |
| AYT CEDULAS CAJAS VIII, FTA             | 4.100.000                           | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 0       | 21.049              |                                    |
| AYT CEDULAS CAJAS X, FTA                | 3.900.000                           | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 0       | 38.518              |                                    |
| AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FTA    | 0                                   | 377.044  | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 17.178  | 1.328               |                                    |
| AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA | 4.484.764                           | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 84.565  | 7.266               |                                    |
| AYT DEUDA SUBORDINADA I, FTA            | 0                                   | 0        | 297.876           | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | -17.500 | 390                 |                                    |
| AYT FONDO EOLICO, FTA                   | 0                                   | 15.300   | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 0       | 82                  |                                    |
| AYT FTPYME II, FTA                      | 0                                   | 70.232   | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 1.255   | 102                 |                                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO II, FTH          | 231.823                             | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 475     | 256                 |                                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO III, FTH         | 255.361                             | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 936     | 222                 |                                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, FTH          | 288.410                             | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 706     | 215                 |                                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH          | 573.510                             | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 4.753   | 464                 |                                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH          | 305.498                             | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 1.738   | 234                 |                                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH         | 683.523                             | 0        | 0                 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0                     | 0     | 0                     | 3.056   | 538                 |                                    |

| FONDO                                  | DEUDA SUBORDINADA Y BONOS TESORERÍA |          |      |                      |                  | DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS |       |   |   | DUDOSOS - DETERIORO | INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES (1) |
|--|-------------------------------------|----------|------|----------------------|------------------|-----------------------------|-------|---|---|---------------------|------------------------------------|
|  | HIPOTECARIOS                        | EMPRESAS | AAPP | CONSUMO Y AUTOMOCIÓN | CUENTAS A COBRAR | BONOS DE TITULIZACIÓN       | OTROS |   |   |                     |                                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH       | 1.018.484                           | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 7.449               | 886                                |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH          | 658.254                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 6.460               | 483                                |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH         | 782.499                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 9.751               | 624                                |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH        | 552.312                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 7.422               | 400                                |
| AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA          | 3.473.276                           | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 32.422              | 2.757                              |
| AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA           | 1.148.476                           | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 8.609               | 885                                |
| AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA            | 1.300.934                           | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 3.717               | 973                                |
| AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA             | 462.297                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 2.402               | 529                                |
| AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA            | 573.148                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 4.059               | 611                                |
| AYT HIPOTECARIO III, FTH               | 77.930                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 780                 | 173                                |
| AYT HIPOTECARIO IV, FTH                | 68.534                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 1.030               | 98                                 |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FTA          | 153.391                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 1.553               | 179                                |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA         | 105.992                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 5.996               | 380                                |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, FTA          | 143.565                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 1.396               | 177                                |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA           | 330.264                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 6.791               | 439                                |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO, FTA             | 79.753                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 1.994               | 155                                |
| AYT ICO FTVPO CAIXA GALICIA I, FTA     | 122.374                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 467                 | 233                                |
| AYT ICO-FTVPO CAJA MURCIA, FTA         | 107.683                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 1.494               | 315                                |
| AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA    | 115.348                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 656                 | 112                                |
| AYT ICO-FTVPO I, FTA                   | 224.110                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 1.710               | 419                                |
| AYT ICO-FTVPO III, FTA                 | 181.879                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 1.732               | 250                                |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA           | 424.233                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 1.550               | 492                                |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA          | 736.620                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 19.323              | 1.454                              |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO IV, FTA          | 1.497.074                           | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 24.578              | 2.745                              |
| AYT PRESTAMOS CONSUMO III, FTA         | 0                                   | 0        | 0    | 0                    | 17.440           | 0                           | 0     | 0 | 0 | 384                 | 70                                 |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS II, FTA  | 43.355                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 5.816               | 89                                 |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS III, FTA | 68.735                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 1.288               | 97                                 |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS IV, FTA  | 42.316                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 7.705               | 84                                 |
| AYT SA NOSTRA FINANCIACION I, FTA      | 0                                   | 0        | 0    | 0                    | 12.637           | 0                           | 0     | 0 | 0 | 200                 | 22                                 |

| FONDO                                   | DEUDA SUBORDINADA Y BONOS TESORERÍA |          |      |                      |                  | DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS |       |   |   | DUDOSOS - DETERIORO | INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES (1) |
|---|-------------------------------------|----------|------|----------------------|------------------|-----------------------------|-------|---|---|---------------------|------------------------------------|
|   | HIPOTECARIOS                        | EMPRESAS | AAPP | CONSUMO Y AUTOMOCIÓN | CUENTAS A COBRAR | BONOS DE TITULIZACIÓN       | OTROS |   |   |                     |                                    |
| AYT UNICAJA FINANCIACION I, FTA         | 0                                   | 0        | 0    | 0                    | 117.772          | 0                           | 0     | 0 | 0 | 2.070               | 490                                |
| AYT VPO II, FTA                         | 109.869                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 659                 | 138                                |
| AYT.1, FTH                              | 29.835                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 488                 | 7                                  |
| AYT.11, FTH                             | 81.538                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 1.119               | 75                                 |
| AYT.2, FTH                              | 15.295                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 157                 | 2                                  |
| AYT.7, PROMOCIONES INMOBILIARIAS I, FTA | 23.199                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 591                 | 77                                 |
| BANCAJA - BVA VPO 1, FTA                | 293.101                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 3.635               | 447                                |
| BANCAJA 10, FTA                         | 1.443.927                           | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 125.877             | 2.293                              |
| BANCAJA 11, FTA                         | 1.203.834                           | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 114.075             | 1.955                              |
| BANCAJA 13, FTA                         | 2.189.259                           | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 169.417             | 3.590                              |
| BANCAJA 3, FTA                          | 151.421                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 3.273               | 205                                |
| BANCAJA 4, FTH                          | 170.999                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 4.843               | 207                                |
| BANCAJA 5, FTA                          | 198.642                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 4.487               | 248                                |
| BANCAJA 6, FTA                          | 449.457                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 11.066              | 561                                |
| BANCAJA 7, FTA                          | 546.974                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 17.910              | 692                                |
| BANCAJA 8, FTA                          | 578.392                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 35.077              | 790                                |
| BANCAJA 9, FTA                          | 838.246                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 69.821              | 1.258                              |
| BANCAJA LEASING 1, FTA                  | 0                                   | 418.830  | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 13.021              | 720                                |
| BANKINTER 10, FTA                       | 737.460                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 6.270               | 579                                |
| BANKINTER 11, FTH                       | 441.098                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 5.106               | 361                                |
| BANKINTER 12, FTH                       | 593.537                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 13.627              | 546                                |
| BANKINTER 13 FTA                        | 881.902                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 14.977              | 763                                |
| BANKINTER 2 PYME FTA                    | 0                                   | 192.431  | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 14.819              | 195                                |
| BANKINTER 2, FTH                        | 33.542                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 366                 | 28                                 |
| BANKINTER 3 FTPYME FTA                  | 0                                   | 230.513  | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 23.056              | 233                                |
| BANKINTER 3, FTH                        | 227.799                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 1.742               | 195                                |
| BANKINTER 4 FTPYME, FTA                 | 0                                   | 172.815  | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 19.381              | 168                                |
| BANKINTER 4, FTH                        | 240.298                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 1.074               | 193                                |
| BANKINTER 5, FTH                        | 168.673                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0 | 1.251               | 142                                |

| FONDO                     | DEUDA SUBORDINADA Y BONOS TESORERÍA |          |      |                      | DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS |       |       |   | BONOS DE TITULIZACIÓN |   | DUDOSOS - DETERIORO | INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES (1) |
|---------------------------|-------------------------------------|----------|------|----------------------|-----------------------------|-------|-------|---|-----------------------|---|---------------------|------------------------------------|
|                           | HIPOTECARIOS                        | EMPRESAS | AAPP | CONSUMO Y AUTOMOCIÓN | CUENTAS A COBRAR            | OTROS | OTROS |   |                       |   |                     |                                    |
| BANKINTER 6, FTA          | 421.128                             | 0        | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 3.526               | 340                                |
| BANKINTER 7, FTH          | 150.614                             | 0        | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 2.556               | 130                                |
| BANKINTER 8, FTA          | 336.082                             | 0        | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 4.166               | 291                                |
| BANKINTER 9, FTA          | 423.917                             | 0        | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 5.294               | 338                                |
| BBVA AUTOS 1 FTA          | 0                                   | 0        | 0    | 0                    | 8.981                       | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 126                 | 34                                 |
| BBVA AUTOS 2 FTA          | 0                                   | 0        | 0    | 0                    | 101.264                     | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 1.069               | 398                                |
| BBVA CONSUMO 1, FTA       | 0                                   | 0        | 0    | 0                    | 131.576                     | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 1.050               | 554                                |
| BBVA CONSUMO 2, FTA       | 0                                   | 0        | 0    | 0                    | 186.468                     | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 1.781               | 759                                |
| BBVA CONSUMO 3 FTA        | 0                                   | 0        | 0    | 0                    | 177.962                     | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 1.870               | 566                                |
| BBVA CONSUMO 4 FTA        | 0                                   | 0        | 0    | 0                    | 419.361                     | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 6.553               | 1.717                              |
| BBVA CONSUMO 5, FTA       | 0                                   | 0        | 0    | 0                    | 590.837                     | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 8.577               | 2.816                              |
| BBVA EMPRESAS 1, FTA      | 0                                   | 190.509  | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 5.997               | 166                                |
| BBVA EMPRESAS 2, FTA      | 0                                   | 845.674  | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 28.352              | 770                                |
| BBVA EMPRESAS 3, FTA      | 0                                   | 615.563  | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 108.241             | 709                                |
| BBVA EMPRESAS 4, FTA      | 0                                   | 529.378  | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 50.176              | 802                                |
| BBVA EMPRESAS 5, FTA      | 0                                   | 624.412  | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 41.590              | 1.524                              |
| BBVA EMPRESAS 6, FTA      | 0                                   | 782.451  | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 57.143              | 2.640                              |
| BBVA FINANZIA AUTOS 1 FTA | 0                                   | 0        | 0    | 0                    | 102.185                     | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 1.406               | 418                                |
| BBVA HIPOTECARIO 3, FTA   | 162.779                             | 0        | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 16.792              | 78                                 |
| BBVA LEASING 1, FTA       | 0                                   | 333.942  | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 7.169               | 324                                |
| BBVA RMBS 1, FTA          | 1.542.873                           | 0        | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 27.931              | 577                                |
| BBVA RMBS 10, FTA         | 1.521.250                           | 0        | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 1.648               | 459                                |
| BBVA RMBS 11, FTA         | 1.369.074                           | 0        | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 1.772               | 644                                |
| BBVA RMBS 2, FTA          | 3.006.076                           | 0        | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 78.124              | 1.148                              |
| BBVA RMBS 3, FTA          | 1.990.417                           | 0        | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 81.716              | 1.596                              |
| BBVA RMBS 5 FTA           | 3.397.009                           | 0        | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 99.710              | 2.495                              |
| BBVA RMBS 9, FTA          | 1.148.764                           | 0        | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 6.740               | 612                                |
| BBVA-3 FTPYME FTA         | 0                                   | 39.498   | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 2.688               | 21                                 |
| BBVA-4 PYME, FTA          | 0                                   | 54.035   | 0    | 0                    | 0                           | 0     | 0     | 0 | 0                     | 0 | 8.600               | 31                                 |

| FONDO                                 | DEUDA SUBORDINADA Y BONOS TESORERÍA |          |      | DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS |                  |       | BONOS DE TITULIZACIÓN |       |                     | INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES (1) |               |        |
|---------------------------------------|-------------------------------------|----------|------|-----------------------------|------------------|-------|-----------------------|-------|---------------------|------------------------------------|---------------|--------|
|                                       | HIPOTECARIOS                        | EMPRESAS | AAPP | CONSUMO Y AUTOMOCIÓN        | CUENTAS A COBRAR | OTROS | DUDOSOS - DETERIORO   | OTROS | DUDOSOS - DETERIORO | OTROS                              | + AJUSTES (1) |        |
| BBVA-5 FTPYME, FTA                    | 0                                   | 151.820  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 22.571        | 113    |
| BBVA-6 FTPYME FTA                     | 0                                   | 187.904  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 22.768        | 165    |
| BBVA-7 FTGENCAT, FTA                  | 0                                   | 43.218   | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 5.574         | 32     |
| BBVA-8 FTPYME FTA                     | 0                                   | 235.754  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 27.741        | 232    |
| BBVA-9 PYME FTA                       | 0                                   | 463.606  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 0             | 935    |
| BCL MUNICIPIOS I FTA                  | 0                                   | 0        | 0    | 90.099                      | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 6.258         | 75     |
| CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA              | 486.971                             | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 4.665         | 696    |
| CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA              | 403.604                             | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 856           | 565    |
| CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA    | 0                                   | 212.890  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 8.931         | 439    |
| CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA        | 0                                   | 197.170  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 11.870        | 453    |
| CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA            | 209.630                             | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 828           | 260    |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, FTA    | 2.000.000                           | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 0             | 57.692 |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 5, FTA    | 2.350.000                           | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 0             | 69.123 |
| CEDULAS TDA 15, FTA                   | 1.327.000                           | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 0             | 24.881 |
| CEDULAS TDA 17, FTA                   | 1.150.000                           | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 0             | 9.675  |
| CEDULAS TDA 18, FTA                   | 800.000                             | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 0             | 20.256 |
| CEDULAS TDA 2, FTA                    | 2.000.000                           | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 0             | 8.647  |
| CEDULAS TDA 21, FONDO DE TITULIZACION | 2.650.000                           | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 0             | 1.238  |
| CEDULAS TDA 3, FTA                    | 2.000.000                           | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 0             | 72.521 |
| CEDULAS TDA 5, FTA                    | 1.500.000                           | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 0             | 5.425  |
| CEDULAS TDA 6, FTA                    | 3.000.000                           | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 0             | 70.705 |
| CEDULAS TDA 7, FTA                    | 2.000.000                           | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 0             | 37.400 |
| CIBELES III FTPYME, FTA               | 0                                   | 38.604   | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 2.990         | 61     |
| CM BANCAJA 1, FTA                     | 61.758                              | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 10.707        | 183    |
| CONSUMO BANCAJA 1, FTA                | 0                                   | 0        | 0    | 0                           | 17.645           | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 565           | 72     |
| DRIVER ESPAÑA ONE, FTA                | 0                                   | 0        | 0    | 0                           | 275.206          | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 2.551         | 592    |
| EDT FTPYME PASTOR 3, FTA              | 0                                   | 28.195   | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 10.854        | 39     |
| EMPRESAS BANESTO 2, FTA               | 0                                   | 422.024  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 42.219        | 1.632  |
| EMPRESAS BANESTO 5, FTA               | 0                                   | 616.576  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                     | 0     | 0                   | 0                                  | 20.301        | 2.004  |

| FONDO  | DEUDA SUBORDINADA Y BONOS TESORERÍA |           | AAPP | CONSUMO Y AUTOMOCIÓN | CUENTAS A COBRAR | DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS |       |       | OTROS | DUDOSOS - DETERIORO | INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES (1) |
|--|-------------------------------------|-----------|------|----------------------|------------------|-----------------------------|-------|-------|-------|---------------------|------------------------------------|
|  | HIPOTECARIOS                        | EMPRESAS  |      |                      |                  | BONOS DE TITULIZACIÓN       | OTROS | OTROS |       |                     |                                    |
| EMPRESAS BANESTO 6, FTA                                    | 0                                   | 642.373   | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 4.820               | 3.146                              |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 3, FTA                        | 0                                   | 167.044   | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 52.743              | 1.031                              |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 5, FTA                        | 0                                   | 503.971   | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 100.189             | 3.220                              |
| FTA PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZ. DE CED. HIPOTECARIA | 1.200.000                           | 0         | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 0                   | 27.781                             |
| FINANCAT 1, FTA  | 0                                   | 0         | 0    | 0                    | 99.692           | 0                           | 0     | 0     | 0     | 4.567               | 612                                |
| FINANCIACION BANESTO 1, FTA                                | 0                                   | 0         | 0    | 0                    | 32.583           | 0                           | 0     | 0     | 0     | 333                 | 159                                |
| FONCAIXA AUTONOMOS 1, FTA                                  | 0                                   | 874.150   | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 15.311              | 3.382                              |
| FONCAIXA CONSUMO 1, FTA                                    | 0                                   | 0         | 0    | 0                    | 2.407.090        | 0                           | 0     | 0     | 0     | 22.543              | 8.391                              |
| FONCAIXA EMPRESAS 3, FTA                                   | 0                                   | 884.602   | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 33.201              | 3.540                              |
| FONCAIXA FTGENCAT 3, FTA                                   | 0                                   | 155.638   | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 2.683               | 390                                |
| FONCAIXA FTGENCAT 4, FTA                                   | 0                                   | 190.517   | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 3.870               | 467                                |
| FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA                                   | 0                                   | 485.031   | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 12.964              | 1.222                              |
| FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA                                   | 0                                   | 359.016   | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 8.084               | 966                                |
| FONCAIXA LEASINGS 1, FTA                                   | 0                                   | 840.633   | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 8.981               | 50                                 |
| FONCAIXA PYMES 3, FTA                                      | 0                                   | 2.256.204 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 2.619               | 5.074                              |
| FTA FTPYME SANTANDER 1                                     | 0                                   | 242.438   | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 4.737               | 345                                |
| FTA FTPYME SANTANDER 2                                     | 0                                   | 314.582   | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 8.475               | 396                                |
| FTA PYMES SANTANDER 3                                      | 0                                   | 1.230.535 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 2.638               | 4.420                              |
| FTA PYMES SANTANDER 4                                      | 0                                   | 2.360.767 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | -16.584             | 5.645                              |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 07-1                     | 0                                   | 0         | 0    | 0                    | 157.367          | 0                           | 0     | 0     | 0     | 1.112               | 531                                |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2011-1                   | 0                                   | 0         | 0    | 0                    | 566.216          | 0                           | 0     | 0     | 0     | 3.293               | 1.891                              |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2012-1                   | 0                                   | 0         | 0    | 0                    | 486.218          | 0                           | 0     | 0     | 0     | -5                  | 3.341                              |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 10, FTA                             | 0                                   | 1.578.834 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 84.668              | 6.291                              |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 2                                   | 0                                   | 297.034   | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 9.944               | 667                                |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 4                                   | 0                                   | 659.931   | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 67.763              | 1.230                              |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 8, FTA                              | 0                                   | 1.779.661 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 169.617             | 8.527                              |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 9, FTA                              | 0                                   | 1.433.078 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0     | 0     | 66.000              | 7.215                              |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 1                               | 0                                   | 0         | 0    | 0                    | 137.592          | 0                           | 0     | 0     | 0     | 986                 | 239                                |

| FONDO  | DEUDA SUBORDINADA Y BONOS TESORERÍA |          |      |                      |                  | DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS |       |   |            | OTROS | DUDOSOS - DETERIORO | INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES (1) |
|--|-------------------------------------|----------|------|----------------------|------------------|-----------------------------|-------|---|------------|-------|---------------------|------------------------------------|
|  | HIPOTECARIOS                        | EMPRESAS | AAPP | CONSUMO Y AUTOMOCIÓN | CUENTAS A COBRAR | BONOS DE TITULIZACIÓN       | OTROS |   |            |       |                     |                                    |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 5                                 | 0                                   | 0        | 0    | 0                    | 550.400          | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 9.872               | 3.663                              |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2                                  | 878.724                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 20.397              | 930                                |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3                                  | 1.451.663                           | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 61.948              | 1.610                              |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 6                                  | 728.909                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 42.362              | 828                                |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 7                                  | 1.446.188                           | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 61.669              | 1.422                              |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 8                                  | 651.120                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 35.263              | 854                                |
| FTA SANTANDER PUBLICO 1                                      | 0                                   | 0        | 0    | 283.423              | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 3.597               | 726                                |
| FTA UCI 11   | 242.312                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 10.468              | 647                                |
| FTA UCI 14   | 535.671                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 103.828             | 1.779                              |
| FTA UCI 16   | 876.442                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 187.590             | 2.473                              |
| FTA UCI 18   | 987.021                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 150.743             | 3.183                              |
| FTA UCI 6  | 44.008                              | 0        | 0    | 0                    | 4.967            | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 624                 | 115                                |
| FTA UCI 7  | 60.864                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 429                 | 143                                |
| FTA UCI 8  | 78.254                              | 0        | 0    | 0                    | 4.204            | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 950                 | 197                                |
| FTA UCI 9  | 226.889                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 3.882               | 521                                |
| FTA, HIPOTEBANSA 11  | 225.670                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 1.413               | 240                                |
| FTA, HIPOTEBANSA X   | 133.394                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 1.102               | 206                                |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 1                                    | 0                                   | 311.505  | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 13.300              | 638                                |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 3                                    | 0                                   | 603.548  | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 36.076              | 1.292                              |
| FTA, UCI 15  | 643.628                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 98.111              | 1.826                              |
| FTA, UCI 17  | 775.621                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 146.732             | 2.537                              |
| FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA | 0                                   | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 14.417.193 | 0     | 0                   | 0                                  |
| FTH UCI 10   | 170.007                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 2.910               | 389                                |
| FTH UCI 12   | 324.267                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 23.842              | 995                                |
| FTH UCI 5  | 22.111                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 268                 | 53                                 |
| FTPyme BANCAJA 2 FTA   | 0                                   | 28.285   | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 6.033               | 30                                 |
| FTPyme BANCAJA 3 FTA   | 0                                   | 44.724   | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 14.064              | 78                                 |
| FTPyme BANCAJA 6 FTA   | 0                                   | 139.390  | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0     | 0 | 0          | 0     | 48.572              | 203                                |



| FONDO                              | DEUDA SUBORDINADA Y BONOS TESORERÍA |          |      | DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS |                  |       |                     | BONOS DE TITULIZACIÓN |                     | INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES (1) |       |
|------------------------------------|-------------------------------------|----------|------|-----------------------------|------------------|-------|---------------------|-----------------------|---------------------|------------------------------------|-------|
|                                    | HIPOTECARIOS                        | EMPRESAS | AAPP | CONSUMO Y AUTOMOCIÓN        | CUENTAS A COBRAR | OTROS | DUDOSOS - DETERIORO | OTROS                 | DUDOSOS - DETERIORO | + AJUSTES (1)                      |       |
| FTPyme TDA 6, FTA                  | 0                                   | 18.676   | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 699                                | 37    |
| FTPyme TDA 7, FTA                  | 0                                   | 67.172   | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 8.132                              | 222   |
| FTPyme TDA CAM 2, FTA              | 0                                   | 65.695   | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 15.505                             | 206   |
| FTPyme TDA CAM 4, FTA              | 0                                   | 314.690  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 63.432                             | 975   |
| FTPyme TDA CAM 7, FTA              | 0                                   | 443.660  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 72.939                             | 1.093 |
| FTPyme TDA CAM 9, FTA              | 0                                   | 377.094  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 43.329                             | 1.252 |
| GAT FTGENCAT 2005, FTA             | 0                                   | 60.230   | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 2.039                              | 156   |
| GAT FTGENCAT 2006, FTA             | 0                                   | 58.551   | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 6.010                              | 149   |
| GAT FTGENCAT 2007, FTA             | 0                                   | 146.482  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 12.257                             | 317   |
| GAT FTGENCAT 2008, FTA             | 0                                   | 244.342  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 26.807                             | 412   |
| GAT FTGENCAT 2009, FTA             | 0                                   | 259.185  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 19.971                             | 496   |
| GAT ICO-FTVPO 1, FTH               | 245.956                             | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 1.324                              | 348   |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 1, FTA  | 0                                   | 85.793   | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 15.009                             | 142   |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 2, FTA  | 0                                   | 101.089  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 8.621                              | 195   |
| GC FTGENCAT CAIXA TARRAGONA 1, FTA | 0                                   | 107.299  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 8.224                              | 136   |
| GC FTGENCAT SABADELL 1, FTA        | 0                                   | 91.166   | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 1.856                              | 14    |
| GC FTPyme PASTOR 4, FTA            | 0                                   | 74.926   | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 7.829                              | 103   |
| GC FTPyme SABADELL 4, FTA          | 0                                   | 101.623  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 6.346                              | 137   |
| GC FTPyme SABADELL 5, FTA          | 0                                   | 205.559  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 5.389                              | 290   |
| GC FTPyme SABADELL 6, FTA          | 0                                   | 227.570  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 11.651                             | 327   |
| GC FTPyme SABADELL 8, FTA          | 0                                   | 490.779  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 23.143                             | 739   |
| GC FTPyme UNNIM 1, FTA             | 0                                   | 199.359  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 10.955                             | 455   |
| GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA       | 376.013                             | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 14.862                             | 218   |
| GC SABADELL 1, FTH                 | 348.774                             | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 2.738                              | 317   |
| GC SABADELL EMPRESAS 2, FTA        | 0                                   | 238.282  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 10.640                             | 43    |
| GC SABADELL EMPRESAS 4, FTA        | 0                                   | 223.749  | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 5.858                              | 27    |
| HIPOCAT 10, FTA                    | 614.272                             | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 55.414                             | 2.419 |
| HIPOCAT 11, FTA                    | 619.688                             | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 62.583                             | 2.611 |
| HIPOCAT 14, FTA                    | 383.097                             | 0        | 0    | 0                           | 0                | 0     | 0                   | 0                     | 0                   | 10.321                             | 1.034 |

| FONDO                             | DEUDA SUBORDINADA Y BONOS TESORERÍA |          |      |                      |                  |                       | DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS |                     |            |        | INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES (1) |  |
|-----------------------------------|-------------------------------------|----------|------|----------------------|------------------|-----------------------|-----------------------------|---------------------|------------|--------|------------------------------------|--|
|                                   | HIPOTECARIOS                        | EMPRESAS | AAPP | CONSUMO Y AUTOMOCIÓN | CUENTAS A COBRAR | BONOS DE TITULIZACIÓN | OTROS                       | DUDOSOS - DETERIORO |            |        |                                    |  |
| HIPOCAT 16, FTA                   | 608.250                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 0          | 3.422  | 1.339                              |  |
| HIPOCAT 17, FTA                   | 740.670                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 0          | 40.682 | 1.511                              |  |
| HIPOCAT 18, FTA                   | 603.200                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 0          | 7.044  | 1.441                              |  |
| HIPOCAT 19, FTA                   | 572.114                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 0          | 30.958 | 1.907                              |  |
| HIPOCAT 20, FTA                   | 734.869                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 0          | 26.710 | 2.403                              |  |
| HIPOCAT 4, FTA                    | 54.135                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 0          | 502    | 202                                |  |
| HIPOCAT 5, FTA                    | 140.388                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 0          | 1.501  | 551                                |  |
| HIPOCAT 6, FTA                    | 214.656                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 0          | 5.109  | 825                                |  |
| HIPOCAT 7, FTA                    | 435.165                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 0          | 16.899 | 1.630                              |  |
| HIPOCAT 8, FTA                    | 542.014                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 0          | 24.888 | 1.902                              |  |
| HIPOCAT 9, FTA                    | 407.239                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 0          | 25.924 | 1.513                              |  |
| ICO MEDIACION I AYT, FTA          | 0                                   | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 533.644    | 0      | 2.288                              |  |
| ICO MEDIACION II AYT FTA          | 0                                   | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 10.504.580 | 0      | 31.258                             |  |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 1, FTA    | 0                                   | 167.669  | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 517        | 16.185 | 639                                |  |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 2, FTA    | 0                                   | 343.517  | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 605        | 36.211 | 1.202                              |  |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 3, FTA    | 0                                   | 876.265  | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 9.570      | 9.863  | 4.124                              |  |
| IM BANCO POPULAR MBS 2, FTA       | 563.913                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 138        | 13.657 | 1.439                              |  |
| IM BANKOA MBS 1, FTA              | 381.472                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 264        | 9.257  | 127                                |  |
| IM BCG RMBS 1, FTA                | 327.782                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 40         | 793    | 230                                |  |
| IM BES EMPRESAS 1, FTA            | 0                                   | 344.725  | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 4.128      | 10.234 | 1.309                              |  |
| IM CAJA LABORAL 1, FTA            | 438.810                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 63         | 3.064  | 351                                |  |
| IM CAJA LABORAL 2, FTA            | 466.421                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 69         | 14.094 | 412                                |  |
| IM CAJA LABORAL EMPRESAS 1, FTA   | 0                                   | 315.566  | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 410        | 9.487  | 330                                |  |
| IM CAJAMAR 1, FTA                 | 117.881                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 107        | 2.413  | 184                                |  |
| IM CAJAMAR 3, FTA                 | 557.722                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 407        | 21.535 | 952                                |  |
| IM CAJAMAR 4, FTA                 | 543.702                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 348        | 19.305 | 922                                |  |
| IM CAJAMAR 5, FTA                 | 628.669                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 412        | 34.148 | 1.478                              |  |
| IM CAJAMAR 6, FTA                 | 1.320.799                           | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 904        | 86.264 | 2.779                              |  |
| IM CAJAMAR EMPRESAS 2 FTPYME, FTA | 0                                   | 134.220  | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0                           | 0                   | 603        | 13.757 | 402                                |  |

| FONDO                                  | DEUDA SUBORDINADA Y BONOS TESORERÍA |           |      |                      | DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS |   |   | BONOS DE TITULIZACIÓN | OTROS  | DUDOSOS - DETERIORO | INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES (1) |
|--|-------------------------------------|-----------|------|----------------------|-----------------------------|---|---|-----------------------|--------|---------------------|------------------------------------|
|  | HIPOTECARIOS                        | EMPRESAS  | AAPP | CONSUMO Y AUTOMOCIÓN | CUENTAS A COBRAR            |   |   |                       |        |                     |                                    |
| IM CAJAMAR EMPRESAS 4, FTA             | 0                                   | 843.993   | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 2.094  | 14.707              | 4.158                              |
| IM CAJASTUR MBS 1, FTA                 | 533.094                             | 0         | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 297    | 8.130               | 524                                |
| IM CEDULAS 1 GRUPO BANCO POPULAR, FTA  | 2.000.000                           | 0         | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 0      | 0                   | 75.234                             |
| IM CEDULAS 10, FTA                     | 1.300.000                           | 0         | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 0      | 0                   | 50.324                             |
| IM CEDULAS 14, FTA                     | 1.200.000                           | 0         | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 0      | 0                   | 29.340                             |
| IM CEDULAS 15, FTA                     | 800.000                             | 0         | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 0      | 0                   | 772                                |
| IM CEDULAS 2, FTA                      | 1.475.000                           | 0         | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 0      | 0                   | 36.772                             |
| IM CEDULAS 3, FTA                      | 1.060.000                           | 0         | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 0      | 0                   | 4.841                              |
| IM CEDULAS 4, FTA                      | 2.075.000                           | 0         | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 0      | 0                   | 62.849                             |
| IM CEDULAS 5, FTA                      | 1.250.000                           | 0         | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 0      | 0                   | 23.766                             |
| IM CEDULAS 7, FTA                      | 1.250.000                           | 0         | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 0      | 0                   | 37.733                             |
| IM CEDULAS 9, FTA                      | 1.275.000                           | 0         | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 0      | 0                   | 30.326                             |
| IM CFS RMBS 1, FTA                     | 377.725                             | 0         | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 138    | 0                   | 385                                |
| IM CITI TARJETAS 1, FTA                | 0                                   | 0         | 0    | 0                    | 1.026.630                   | 0 | 0 | 0                     | 38     | 114                 | 18.502                             |
| IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA            | 0                                   | 163.514   | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 145    | 1.491               | 28                                 |
| IM FTGENCAT SABADELL 3, FTA            | 0                                   | 78.410    | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 227    | 6.047               | 68                                 |
| IM FTGENCAT SABADELL 4, FTA            | 0                                   | 145.556   | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 337    | 5.515               | 97                                 |
| IM FTPYME SABADELL 3, FTA              | 0                                   | 54.437    | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 49     | 1.960               | 137                                |
| IM FTPYME SABADELL 7, FTA              | 0                                   | 310.794   | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 833    | 12.704              | 266                                |
| IM FTPYME SABADELL 9, FTA              | 0                                   | 1.057.972 | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 2.827  | 20.823              | 1.181                              |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, FTA | 0                                   | 265.926   | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 706    | 36.235              | 902                                |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 3, FTA | 0                                   | 658.254   | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 2.507  | 43.336              | 3.556                              |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 4, FTA | 0                                   | 1.014.856 | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 10.429 | 21.417              | 3.218                              |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I FTA    | 0                                   | 378.514   | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 1.032  | 43.474              | 1.291                              |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME II, FTA  | 0                                   | 249.432   | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 977    | 25.765              | 1.255                              |
| IM GRUPO BANCO POPULAR LEASING 2, FTA  | 0                                   | 725.703   | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 4.093  | 10.456              | 499                                |
| IM PASTOR 2, FTH                       | 257.985                             | 0         | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 189    | 3.016               | 49                                 |
| IM PASTOR 3, FTH                       | 299.047                             | 0         | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 368    | 30.883              | 164                                |
| IM PASTOR 4, FTA                       | 385.283                             | 0         | 0    | 0                    | 0                           | 0 | 0 | 0                     | 379    | 32.072              | 176                                |

| FONDO                                | DEUDA SUBORDINADA Y BONOS TESORERÍA |           |   | AAPP | CONSUMO Y AUTOMOCIÓN | CUENTAS A COBRAR | DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS |   |   | OTROS   | DUDOSOS - DETERIORO | INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES (1) |
|--------------------------------------|-------------------------------------|-----------|---|------|----------------------|------------------|-----------------------------|---|---|---------|---------------------|------------------------------------|
|                                      | HIPOTECARIOS                        | EMPRESAS  |   |      |                      |                  | BONOS DE TITULIZACIÓN       |   |   |         |                     |                                    |
| IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, FTA     | 0                                   | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 178.692 | 0                   | 1.415                              |
| IM SABADELL EMPRESAS 1, FTA          | 0                                   | 170.441   | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 577     | 5.596               | 174                                |
| IM SABADELL EMPRESAS 3, FTA          | 0                                   | 552.326   | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 1.385   | 18.178              | 460                                |
| IM SABADELL EMPRESAS 5, FTA          | 0                                   | 200.761   | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 864     | 13.976              | 251                                |
| IM SABADELL RMBS 2, FTA              | 818.377                             | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 455     | 19.769              | 270                                |
| IM SABADELL RMBS 3, FTA              | 910.210                             | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 470     | 26.488              | 369                                |
| IM TERRASSA 1 FTGENCAT FTA           | 0                                   | 43.628    | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 95      | 4.661               | 74                                 |
| IM TERRASSA MBS 1, FTA               | 205.493                             | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 158     | 7.560               | 316                                |
| INTERMONEY MASTER CEDULAS, FTA       | 1.655.000                           | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 0                   | 4.680                              |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS III, FTA | 0                                   | 620.821   | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 0                   | 1.888                              |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS IV, FTA  | 0                                   | 631.705   | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 0                   | 1.236                              |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS V, FTA   | 0                                   | 1.076.122 | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 0                   | 5.573                              |
| MADRID CONSUMO I, FTA                | 0                                   | 0         | 0 | 0    | 136.607              | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 1.454               | 1.363                              |
| MADRID FTPYME I, FTA                 | 0                                   | 608.132   | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 11.744              | 897                                |
| MADRID FTPYME II, FTA                | 0                                   | 645.964   | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 6.226               | 1.212                              |
| MADRID ICO-FTVPO I, FTA              | 189.213                             | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 729                 | 144                                |
| MADRID RESIDENCIAL I, FTA            | 566.076                             | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 18.048              | 570                                |
| MADRID RESIDENCIAL II, FTA           | 511.147                             | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 12.427              | 510                                |
| MADRID RMBS I, FTA                   | 956.449                             | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 36.841              | 1.226                              |
| MADRID RMBS II, FTA                  | 843.378                             | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 42.059              | 1.144                              |
| MADRID RMBS III FTA                  | 1.569.041                           | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 91.581              | 2.359                              |
| MADRID RMBS IV, FTA                  | 1.237.973                           | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 62.247              | 1.596                              |
| MBS BANCAJA 1 FTA                    | 105.868                             | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 4.921               | 152                                |
| MBS BANCAJA 2, FTA                   | 233.275                             | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 14.589              | 322                                |
| MBS BANCAJA 3, FTA                   | 316.822                             | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 21.826              | 488                                |
| MBS BANCAJA 4, FTA                   | 885.406                             | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 78.817              | 1.389                              |
| MBS BANCAJA 6, FTA                   | 695.159                             | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 53.843              | 1.156                              |
| MBS BANCAJA 7, FTA                   | 715.584                             | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 61.622              | 1.288                              |
| MBS BANCAJA 8, FTA                   | 374.789                             | 0         | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0       | 33.791              | 686                                |

| FONDO                                     | DEUDA SUBORDINADA Y BONOS TESORERÍA |          |   | AAPP | CONSUMO Y AUTOMOCIÓN | CUENTAS A COBRAR | DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS |   |   | OTROS | DUDOSOS - DETERIORO | INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES (1) |
|---|-------------------------------------|----------|---|------|----------------------|------------------|-----------------------------|---|---|-------|---------------------|------------------------------------|
|   | HIPOTECARIOS                        | EMPRESAS |   |      |                      |                  | BONOS DE TITULIZACIÓN       |   |   |       |                     |                                    |
| MBSCAT 1, FTA                             | 654.307                             | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 25.998              | 2.009                              |
| MBSCAT 2, FTA                             | 290.583                             | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 26.665              | 837                                |
| PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA                 | 10.160.000                          | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 0                   | 238.710                            |
| PYME BANCAJA 5, FTA                       | 0                                   | 93.621   | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 29.876              | 127                                |
| PYME BANCAJA 7, FTA                       | 0                                   | 281.043  | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 92.504              | 392                                |
| PYME VALENCIA 1, FTA                      | 0                                   | 141.895  | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 36.145              | 364                                |
| PYME VALENCIA 2, FTA                      | 0                                   | 158.022  | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 22.228              | 334                                |
| PYMECAT 2 FTPYME, FTA                     | 0                                   | 122.584  | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 9.891               | 258                                |
| PYMECAT 3 FTPYME, FTA                     | 0                                   | 306.548  | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 13.467              | 692                                |
| PYMES BANESTO 2, FTA                      | 0                                   | 213.696  | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 15.522              | 542                                |
| RURAL CEDULA I, FTA                       | 1.000.000                           | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 0                   | 32.292                             |
| RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA           | 409.441                             | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 20.995              | 601                                |
| RURAL HIPOTECARIO II FTH                  | 21.783                              | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 546                 | 29                                 |
| RURAL HIPOTECARIO III FTH                 | 50.989                              | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 1.004               | 81                                 |
| RURAL HIPOTECARIO IV FTH                  | 99.270                              | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 2.282               | 140                                |
| RURAL HIPOTECARIO IX, FTA                 | 813.810                             | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 57.943              | 1.309                              |
| RURAL HIPOTECARIO V FTA                   | 181.089                             | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 3.533               | 197                                |
| RURAL HIPOTECARIO VI, FTA                 | 297.219                             | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 8.833               | 426                                |
| RURAL HIPOTECARIO VII, FTA                | 398.312                             | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 12.756              | 582                                |
| RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA               | 602.580                             | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 25.950              | 944                                |
| RURAL HIPOTECARIO X, FTA                  | 1.214.877                           | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 57.566              | 1.859                              |
| RURAL HIPOTECARIO XI, FTA                 | 1.539.026                           | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 77.286              | 2.257                              |
| RURAL HIPOTECARIO XII, FTA                | 706.327                             | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 33.426              | 738                                |
| RURALPYME 1 FTPYME FTA                    | 0                                   | 21.478   | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 918                 | 40                                 |
| RURALPYME 2 FTPYME FTA                    | 0                                   | 111.553  | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 16.939              | 371                                |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN 09-1, FTA        | 0                                   | 0        | 0 | 0    | 144.793              | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 1.734               | 610                                |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2010-1, FTA | 0                                   | 0        | 0 | 0    | 247.304              | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 1.771               | 889                                |
| SANTANDER HIPOTECARIO I, FTA              | 585.115                             | 0        | 0 | 0    | 0                    | 0                | 0                           | 0 | 0 | 0     | 5.325               | 651                                |

| FONDO               | DEUDA SUBORDINADA Y BONOS TESORERÍA |          |      |                      |                  |                       |       | DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS |   |        | DUDOSOS - DETERIORO | INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES (1) |
|---------------------|-------------------------------------|----------|------|----------------------|------------------|-----------------------|-------|-----------------------------|---|--------|---------------------|------------------------------------|
|                     | HIPOTECARIOS                        | EMPRESAS | AAPP | CONSUMO Y AUTOMOCIÓN | CUENTAS A COBRAR | BONOS DE TITULIZACIÓN | OTROS |                             |   |        |                     |                                    |
| SOL-LION, FTA       | 3.192.505                           | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 19.160 | 3.662               |                                    |
| TDA 11, FTH         | 52.035                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 800    | 58                  |                                    |
| TDA 12, FTH         | 48.939                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 504    | 85                  |                                    |
| TDA 13 - MIXTO, FTA | 50.176                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 530    | 41                  |                                    |
| TDA 14 - MIXTO, FTA | 97.829                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 843    | 170                 |                                    |
| TDA 15 - MIXTO, FTA | 101.873                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 1.884  | 168                 |                                    |
| TDA 16 - MIXTO, FTA | 105.905                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 3.149  | 253                 |                                    |
| TDA 17 - MIXTO, FTA | 83.099                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 2.756  | 227                 |                                    |
| TDA 18 - MIXTO, FTA | 107.924                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 2.413  | 207                 |                                    |
| TDA 19 - MIXTO, FTA | 173.122                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 3.171  | 219                 |                                    |
| TDA 20 - MIXTO, FTA | 129.850                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 917    | 139                 |                                    |
| TDA 22 - MIXTO, FTA | 161.768                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 13.145 | 363                 |                                    |
| TDA 23, FTA         | 278.513                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 19.504 | 641                 |                                    |
| TDA 24, FTA         | 185.930                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 26.194 | 672                 |                                    |
| TDA 25, FTA         | 98.888                              | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 39.759 | 761                 |                                    |
| TDA 26 - MIXTO, FTA | 346.251                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 13.129 | 802                 |                                    |
| TDA 27, FTA         | 451.732                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 56.091 | 1.274               |                                    |
| TDA 28, FTA         | 232.201                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 62.928 | 1.356               |                                    |
| TDA 29, FTA         | 432.016                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 21.507 | 1.025               |                                    |
| TDA 30, FTA         | 254.749                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 5.472  | 690                 |                                    |
| TDA 31, FTA         | 164.632                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 15.071 | 390                 |                                    |
| TDA CAJAMAR 2, FTA  | 369.179                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 11.140 | 704                 |                                    |
| TDA CAM 1, FTA      | 217.978                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 5.454  | 159                 |                                    |
| TDA CAM 10, FTA     | 648.741                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 94.135 | 1.245               |                                    |
| TDA CAM 11, FTA     | 1.100.431                           | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 97.696 | 1.159               |                                    |
| TDA CAM 12, FTA     | 1.315.955                           | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 89.438 | 1.499               |                                    |
| TDA CAM 2, FTA      | 245.058                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 8.552  | 346                 |                                    |
| TDA CAM 3, FTA      | 272.469                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 8.847  | 404                 |                                    |
| TDA CAM 4, FTA      | 658.092                             | 0        | 0    | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 27.456 | 580                 |                                    |

| FONDO                                   | DEUDA SUBORDINADA Y BONOS TESORERÍA |          |       |                      |                  |                       |       | DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS |   |         | DUDOSOS - DETERIORO | INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES (1) |
|---|-------------------------------------|----------|-------|----------------------|------------------|-----------------------|-------|-----------------------------|---|---------|---------------------|------------------------------------|
|   | HIPOTECARIOS                        | EMPRESAS | AAPP  | CONSUMO Y AUTOMOCIÓN | CUENTAS A COBRAR | BONOS DE TITULIZACIÓN | OTROS |                             |   |         |                     |                                    |
| TDA CAM 5, FTA                          | 863.249                             | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 64.841  | 995                 |                                    |
| TDA CAM 6, FTA                          | 562.859                             | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 62.761  | 956                 |                                    |
| TDA CAM 7, FTA                          | 848.454                             | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 90.226  | 1.249               |                                    |
| TDA CAM 8, FTA                          | 861.628                             | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 78.497  | 1.239               |                                    |
| TDA CAM 9, FTA                          | 758.058                             | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 100.528 | 1.332               |                                    |
| TDA CORPORATIVOS I, FTA                 | 0                                   | 290.440  | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 5.913   | 330                 |                                    |
| TDA EMPRESAS 1, FTA                     | 0                                   | 47.482   | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 1.842   | 258                 |                                    |
| TDA EMPRESAS 2, FTA                     | 0                                   | 47.435   | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 3.140   | 181                 |                                    |
| TDA FTPYME PASTOR 9, FTA                | 0                                   | 233.405  | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 12.314  | 827                 |                                    |
| TDA IBERCAJA 1, FTA                     | 165.348                             | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 338     | 32                  |                                    |
| TDA IBERCAJA 2, FTA                     | 393.654                             | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 1.592   | 86                  |                                    |
| TDA IBERCAJA 3, FTA                     | 484.942                             | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 3.443   | 112                 |                                    |
| TDA IBERCAJA 4, FTA                     | 718.437                             | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 7.328   | 250                 |                                    |
| TDA IBERCAJA 5, FTA                     | 698.848                             | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 7.823   | 225                 |                                    |
| TDA IBERCAJA 6, FTA                     | 1.005.326                           | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 19.910  | 421                 |                                    |
| TDA IBERCAJA 7, FTA                     | 1.653.240                           | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 10.927  | 302                 |                                    |
| TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH             | 156.143                             | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 153.132 | 382                 |                                    |
| TDA LICO LEASING III, FTA               | 0                                   | 123.455  | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 0       | 254                 |                                    |
| TDA PASTOR 1, FTA                       | 95.608                              | 0        | 1.503 | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 256     | 99                  |                                    |
| TDA PASTOR CONSUMO 1, FTA               | 0                                   | 0        | 0     | 0                    | 25.381           | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 750     | 275                 |                                    |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA           | 0                                   | 57.306   | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 358     | 68                  |                                    |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA           | 0                                   | 124.090  | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 3.700   | 103                 |                                    |
| TDA TARRAGONA 1, FTA                    | 242.527                             | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 27.044  | 428                 |                                    |
| UNICAJA ANDALUCIA FTVIVIENDA TDA 1, FTA | 98.592                              | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 49.803  | 510                 |                                    |
| UNICAJA AYT EMPRESAS I, FTA             | 0                                   | 113.893  | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 2.763   | 228                 |                                    |
| UNICAJA TDA VPO, FTA                    | 50.065                              | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 99.566  | 570                 |                                    |
| VAL BANCAJA 1, FTA                      | 239.193                             | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 11.996  | 396                 |                                    |
| VALENCIA HIPOTECARIO 1, FTA             | 126.426                             | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 2.086   | 155                 |                                    |
| VALENCIA HIPOTECARIO 2, FTH             | 371.136                             | 0        | 0     | 0                    | 0                | 0                     | 0     | 0                           | 0 | 19.741  | 502                 |                                    |

| FONDO                          | DEUDA SUBORDINADA Y BONOS TESORERÍA |                   |                  |                      |                   |                  | DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS |          |                     | BONOS DE TITULIZACIÓN |                     | INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES (1) |  |
|--------------------------------|-------------------------------------|-------------------|------------------|----------------------|-------------------|------------------|-----------------------------|----------|---------------------|-----------------------|---------------------|------------------------------------|--|
|                                | HIPOTECARIOS                        | EMPRESAS          | AAPP             | CONSUMO Y AUTOMOCIÓN | CUENTAS A COBRAR  | OTROS            | DUDOSOS - DETERIORO         | OTROS    | DUDOSOS - DETERIORO | OTROS                 | DUDOSOS - DETERIORO | OTROS                              |  |
| VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA    | 451.893                             | 0                 | 0                | 0                    | 0                 | 0                | 0                           | 0        | 0                   | 0                     | 23.460              | 727                                |  |
| VALENCIA HIPOTECARIO 4, FTA    | 545.642                             | 0                 | 0                | 0                    | 0                 | 0                | 0                           | 0        | 0                   | 0                     | 70.028              | 941                                |  |
| VALENCIA HIPOTECARIO 5, FTA    | 343.008                             | 0                 | 0                | 0                    | 0                 | 0                | 0                           | 0        | 0                   | 0                     | 37.848              | 579                                |  |
| <b>Subtotal BONOS 2012 2</b>   | <b>227.298.298</b>                  | <b>46.239.510</b> | <b>299.379</b>   | <b>373.522</b>       | <b>8.956.637</b>  | <b>0</b>         | <b>0</b>                    | <b>0</b> | <b>0</b>            | <b>25.684.363</b>     | <b>7.858.693</b>    | <b>2.335.037</b>                   |  |
| De los cuales cédulas          | 108.385.689                         |                   |                  | 0                    |                   |                  |                             |          |                     |                       |                     |                                    |  |
| <b>Subtotal BONOS 2011 2</b>   | <b>288.926.655</b>                  | <b>68.677.951</b> | <b>3.408.379</b> | <b>2.121.469</b>     | <b>11.544.791</b> | <b>0</b>         | <b>0</b>                    | <b>0</b> | <b>0</b>            | <b>26.642.589</b>     | <b>6.454.591</b>    | <b>2.888.831</b>                   |  |
| <b>%Variación</b>              | <b>-21,33</b>                       | <b>-32,67</b>     | <b>-91,22</b>    | <b>-82,39</b>        | <b>-22,42</b>     | <b>-</b>         | <b>-</b>                    | <b>-</b> | <b>-</b>            | <b>-3,60</b>          | <b>21,75</b>        | <b>-19,17</b>                      |  |
| <b>PAGARÉS</b>                 |                                     |                   |                  |                      |                   |                  |                             |          |                     |                       |                     |                                    |  |
| FTA SANTANDER 2                | 0                                   | 0                 | 0                | 0                    | 0                 | 1.288.284        | 0                           | 0        | 0                   | 0                     | 12.430              | 0                                  |  |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2012 2</b> | <b>0</b>                            | <b>0</b>          | <b>0</b>         | <b>0</b>             | <b>0</b>          | <b>1.288.284</b> | <b>0</b>                    | <b>0</b> | <b>0</b>            | <b>0</b>              | <b>12.430</b>       | <b>0</b>                           |  |
| De los cuales cédulas          | 0                                   |                   |                  | 0                    |                   |                  |                             |          |                     |                       |                     |                                    |  |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2011 2</b> | <b>0</b>                            | <b>0</b>          | <b>0</b>         | <b>0</b>             | <b>0</b>          | <b>1.507.904</b> | <b>0</b>                    | <b>0</b> | <b>0</b>            | <b>0</b>              | <b>8.722</b>        | <b>17.089</b>                      |  |
| <b>%Variación</b>              | <b>-</b>                            | <b>-</b>          | <b>-</b>         | <b>-</b>             | <b>-</b>          | <b>-14,56</b>    | <b>-</b>                    | <b>-</b> | <b>-</b>            | <b>-</b>              | <b>42,51</b>        | <b>-100,00</b>                     |  |
| <b>Total 2012 2</b>            | <b>227.298.298</b>                  | <b>46.239.510</b> | <b>299.379</b>   | <b>373.522</b>       | <b>8.956.637</b>  | <b>1.288.284</b> | <b>0</b>                    | <b>0</b> | <b>0</b>            | <b>25.684.363</b>     | <b>7.871.123</b>    | <b>2.335.037</b>                   |  |
| De los cuales cédulas          | 108.385.689                         |                   |                  | 0                    |                   |                  |                             |          |                     |                       |                     |                                    |  |
| <b>Total 2011 2</b>            | <b>288.926.655</b>                  | <b>68.677.951</b> | <b>3.408.379</b> | <b>2.121.469</b>     | <b>11.544.791</b> | <b>1.507.904</b> | <b>0</b>                    | <b>0</b> | <b>0</b>            | <b>26.642.589</b>     | <b>6.463.313</b>    | <b>2.905.920</b>                   |  |
| <b>%Variación</b>              | <b>-21,33</b>                       | <b>-32,67</b>     | <b>-91,22</b>    | <b>-82,39</b>        | <b>-22,42</b>     | <b>-14,56</b>    | <b>-</b>                    | <b>-</b> | <b>-</b>            | <b>-3,60</b>          | <b>21,78</b>        | <b>-19,65</b>                      |  |

Nota: Importes en miles de euros

**Información sobre los encabezados**

(1) Incluye intereses vencidos e impagados



| FONDO                                   | TAA (1) | % DEUDA / VT<br>(2) | DUDOSOS<br>(3) | FALLIDOS<br>(4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD<br>(7) | TASA DE CONCENTRACIÓN |            |            |
|---|---------|---------------------|----------------|-----------------|------------------------------|----------------------|-------------------|-----------------------|------------|------------|
|   |         |                     |                |                 |                              |                      |                   | POR DEUDOR<br>(8)     | GEOGRÁFICA |            |
|   |         |                     |                |                 |                              |                      |                   |                       | ÁREA       | PORCENTAJE |
| AYT CAIXA SABADELL HIPOTECARIO I, FTA   | 2,48    | 85,95               | 16,29          | 0,00            | 0,00                         | 26,65                | 6,99              | 1,76                  | CATALUÑA   | 99,95      |
| AYT CAIXANOVA HIPOTECARIO I, FTA        | 6,17    | 52,62               | 5,68           | 0,00            | 0,00                         | 18,29                | 7,92              | 9,37                  | GALICIA    | 89,89      |
| AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA              | 5,46    | 112,68              | 0,10           | 0,00            | 0,00                         | 52,00                | 9,76              | 4,00                  | CATALUÑA   | 70,37      |
| AYT CAJA MURCIA HIPOTECARIO I, FTA      | 4,97    | 49,60               | 1,30           | 0,00            | 0,00                         | 12,47                | 9,68              | 1,88                  | MURCIA     | 75,63      |
| AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA      | 5,03    | 63,95               | 7,60           | 0,00            | 0,00                         | 21,95                | 6,96              | 1,93                  | ANDALUCÍA  | 79,24      |
| AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FTA      | 5,51    | 46,89               | 0,59           | 0,00            | 0,00                         | 13,58                | 8,79              | 2,11                  | MURCIA     | 58,97      |
| AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA            | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 4,81                 | 5,66              | 41,18                 | PAÍS VASCO | 18,57      |
| AYT CEDULAS CAJAS IV, FTA               | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 0,20                 | 9,80              | 67,37                 | ANDALUCÍA  | 21,18      |
| AYT CEDULAS CAJAS IX, FTA               | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 3,80                 | 7,76              | 61,10                 | CATALUÑA   | 21,00      |
| AYT CEDULAS CAJAS V, FTA                | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 4,29                 | 9,08              | 63,74                 | CATALUÑA   | 28,23      |
| AYT CEDULAS CAJAS VI, FTA               | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 1,30                 | 8,74              | 76,36                 | ANDALUCÍA  | 20,61      |
| AYT CEDULAS CAJAS VIII, FTA             | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 3,24                 | 8,12              | 70,98                 | CATALUÑA   | 30,85      |
| AYT CEDULAS CAJAS X, FTA                | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 7,63                 | 7,51              | 89,55                 | GALICIA    | 20,51      |
| AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA | 7,57    | 0,00                | 3,06           | 0,00            | 0,00                         | 23,52                | 7,73              | 0,18                  | PAÍS VASCO | 25,33      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO II, FTH          | 4,95    | 37,76               | 0,53           | 0,03            | 0,00                         | 16,50                | 10,50             | 1,50                  | MADRID     | 42,00      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO III, FTH         | 4,50    | 38,74               | 0,76           | 0,00            | 0,00                         | 17,08                | 10,03             | 1,66                  | MADRID     | 41,53      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, FTH          | 4,90    | 37,92               | 0,34           | 0,03            | 0,00                         | 18,69                | 9,56              | 1,26                  | MADRID     | 39,62      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH          | 3,64    | 47,67               | 1,16           | 0,26            | 0,00                         | 20,12                | 7,15              | 1,49                  | MADRID     | 25,10      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH          | 4,87    | 41,46               | 0,76           | 0,09            | 0,00                         | 19,08                | 8,66              | 1,96                  | MADRID     | 30,19      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH         | 3,94    | 43,70               | 0,84           | 0,25            | 0,00                         | 19,61                | 8,22              | 0,86                  | MADRID     | 22,37      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH        | 4,31    | 41,92               | 0,96           | 0,05            | 0,00                         | 17,31                | 8,61              | 0,67                  | MADRID     | 31,30      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH           | 3,13    | 47,65               | 1,71           | 0,19            | 0,00                         | 20,15                | 6,82              | 1,07                  | CATALUÑA   | 21,65      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH          | 2,82    | 47,22               | 1,98           | 0,40            | 0,00                         | 21,74                | 6,47              | 1,08                  | MADRID     | 27,23      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH         | 2,79    | 47,99               | 1,86           | 0,10            | 0,00                         | 20,99                | 6,07              | 1,44                  | MADRID     | 23,67      |
| AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA           | 2,67    | 53,78               | 1,03           | 0,00            | 0,00                         | 23,23                | 3,97              | 0,40                  | MADRID     | 24,05      |
| AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA            | 3,40    | 51,24               | 0,83           | 0,00            | 0,00                         | 22,87                | 3,46              | 1,34                  | MADRID     | 25,43      |
| AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA             | 2,63    | 51,79               | 0,28           | 0,00            | 0,00                         | 22,26                | 5,09              | 0,81                  | MADRID     | 31,38      |
| AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA              | 2,80    | 72,42               | 1,55           | 0,00            | 0,00                         | 19,17                | 9,67              | 0,68                  | PAÍS VASCO | 64,20      |
| AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA             | 2,81    | 70,58               | 1,57           | 0,00            | 0,00                         | 19,87                | 8,87              | 0,70                  | PAÍS VASCO | 56,93      |
| AYT HIPOTECARIO III, FTH                | 4,66    | 38,37               | 1,49           | 0,00            | 0,00                         | 11,90                | 11,07             | 1,40                  | NAVARRA    | 34,36      |
| AYT HIPOTECARIO IV, FTH                 | 5,55    | 36,97               | 1,55           | 0,00            | 0,00                         | 11,20                | 12,27             | 2,84                  | ANDALUCÍA  | 50,16      |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FTA           | 4,38    | 46,06               | 1,28           | 0,00            | 0,00                         | 14,18                | 10,57             | 1,69                  | ANDALUCÍA  | 46,66      |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA          | 2,80    | 58,99               | 13,80          | 1,69            | 0,00                         | 19,30                | 8,98              | 1,60                  | ANDALUCÍA  | 64,71      |

| FONDO                                   | TAA (1) | % DEUDA / VT<br>(2) | DUDOSOS<br>(3) | FALLIDOS<br>(4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD<br>(7) | TASA DE CONCENTRACIÓN |              |            |
|---|---------|---------------------|----------------|-----------------|------------------------------|----------------------|-------------------|-----------------------|--------------|------------|
|   |         |                     |                |                 |                              |                      |                   | POR DEUDOR<br>(8)     | GEOGRÁFICA   |            |
|   |         |                     |                |                 |                              |                      |                   |                       | ÁREA         | PORCENTAJE |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, FTA           | 5,28    | 44,67               | 1,39           | 0,00            | 0,00                         | 15,42                | 9,41              | 2,13                  | NAVARRA      | 54,51      |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA            | 4,55    | 62,36               | 2,67           | 0,00            | 0,00                         | 18,73                | 8,52              | 1,06                  | NAVARRA      | 39,19      |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO, FTA              | 2,99    | 46,41               | 6,43           | 0,51            | 0,00                         | 16,02                | 10,82             | 1,77                  | ANDALUCÍA    | 39,34      |
| AYT ICO FTVPO CAIXA GALICIA I, FTA      | 2,95    | 47,23               | 0,37           | 0,00            | 0,00                         | 13,83                | 6,88              | 0,85                  | GALICIA      | 84,35      |
| AYT ICO-FTVPO CAJA MURCIA, FTA          | 2,29    | 56,30               | 1,36           | 0,00            | 0,00                         | 13,94                | 6,65              | 0,75                  | MURCIA       | 58,12      |
| AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA     | 3,80    | 63,92               | 0,74           | 0,00            | 0,00                         | 23,15                | 7,09              | 2,21                  | PAÍS VASCO   | 92,52      |
| AYT ICO-FTVPO I, FTA                    | 3,31    | 57,02               | 1,10           | 0,00            | 0,00                         | 14,34                | 8,07              | 1,43                  | NAVARRA      | 31,77      |
| AYT ICO-FTVPO III, FTA                  | 3,25    | 54,75               | 0,93           | 0,00            | 0,00                         | 14,11                | 7,82              | 1,50                  | ARAGÓN       | 53,22      |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA            | 3,11    | 63,23               | 0,76           | 0,00            | 0,00                         | 20,52                | 8,87              | 0,79                  | PAÍS VASCO   | 51,51      |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA           | 4,59    | 67,07               | 5,64           | 0,00            | 0,00                         | 22,86                | 8,09              | 0,45                  | PAÍS VASCO   | 42,63      |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO IV, FTA           | 6,94    | 57,68               | 2,33           | 0,00            | 0,00                         | 24,52                | 6,71              | 0,54                  | PAÍS VASCO   | 30,47      |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS II, FTA   | 4,23    | 48,01               | 14,67          | 0,00            | 0,00                         | 14,71                | 10,00             | 13,65                 | ANDALUCÍA    | 88,66      |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS III, FTA  | 7,51    | 49,78               | 2,63           | 0,00            | 0,00                         | 22,57                | 6,23              | 6,93                  | PAÍS VASCO   | 92,16      |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS IV, FTA   | 12,21   | 51,74               | 22,84          | 0,00            | 0,00                         | 17,34                | 6,23              | 21,85                 | ANDALUCÍA    | 88,83      |
| AYT VPO II, FTA                         | 2,66    | 50,49               | 1,73           | 0,00            | 0,00                         | 12,95                | 8,61              | 2,76                  | CANARIAS     | 50,33      |
| AYT.1, FTH                              | 5,53    | 39,25               | 1,55           | 0,00            | 0,00                         | 8,40                 | 12,23             | 3,07                  | GALICIA      | 51,40      |
| AYT.11, FTH                             | 4,35    | 44,13               | 1,93           | 0,00            | 0,00                         | 13,09                | 11,81             | 1,46                  | ANDALUCÍA    | 41,42      |
| AYT.2, FTH                              | 5,41    | 28,93               | 1,05           | 0,00            | 0,00                         | 4,46                 | 12,97             | 5,34                  | CANARIAS     | 56,02      |
| AYT.7, PROMOCIONES INMOBILIARIAS I, FTA | 6,40    | 42,13               | 6,96           | 0,00            | 0,00                         | 12,62                | 6,58              | 15,68                 | ANDALUCÍA    | 37,56      |
| BANCAJA - BVA VPO 1, FTA                | 1,96    | 55,65               | 1,21           | 0,09            | 0,00                         | 14,93                | 7,92              | 1,41                  | C.VALENCIANA | 76,99      |
| BANCAJA 10, FTA                         | 3,44    | 65,08               | 7,86           | 1,87            | 0,31                         | 23,90                | 7,05              | 0,20                  | C.VALENCIANA | 32,78      |
| BANCAJA 11, FTA                         | 3,42    | 66,42               | 8,60           | 2,05            | 0,05                         | 26,61                | 6,54              | 0,36                  | C.VALENCIANA | 33,99      |
| BANCAJA 13, FTA                         | 3,38    | 72,91               | 7,41           | 0,49            | 0,31                         | 30,59                | 5,44              | 0,31                  | C.VALENCIANA | 36,37      |
| BANCAJA 3, FTA                          | 4,59    | 28,02               | 2,11           | 0,01            | 0,00                         | 8,60                 | 10,87             | 1,26                  | C.VALENCIANA | 69,66      |
| BANCAJA 4, FTH                          | 3,81    | 39,11               | 2,73           | 0,11            | 0,00                         | 12,96                | 11,48             | 1,08                  | C.VALENCIANA | 55,87      |
| BANCAJA 5, FTA                          | 3,55    | 44,96               | 2,20           | 0,00            | 0,00                         | 13,77                | 11,16             | 0,94                  | C.VALENCIANA | 53,76      |
| BANCAJA 6, FTA                          | 3,43    | 53,21               | 2,39           | 0,06            | 0,00                         | 14,49                | 11,03             | 0,49                  | C.VALENCIANA | 58,47      |
| BANCAJA 7, FTA                          | 3,51    | 48,00               | 3,13           | 0,18            | 0,23                         | 16,21                | 9,58              | 0,55                  | C.VALENCIANA | 44,69      |
| BANCAJA 8, FTA                          | 3,09    | 57,81               | 5,55           | 0,83            | 0,11                         | 18,85                | 8,64              | 0,71                  | C.VALENCIANA | 36,83      |
| BANCAJA 9, FTA                          | 3,90    | 60,00               | 7,53           | 1,85            | 0,27                         | 20,56                | 7,91              | 0,65                  | C.VALENCIANA | 35,94      |
| BANKINTER 10, FTA                       | 3,36    | 45,21               | 0,84           | 0,02            | 0,00                         | 19,39                | 8,57              | 0,86                  | MADRID       | 34,93      |
| BANKINTER 11, FTH                       | 3,23    | 45,61               | 1,14           | 0,03            | 0,00                         | 20,43                | 8,48              | 1,26                  | MADRID       | 33,74      |
| BANKINTER 12, FTH                       | 3,04    | 46,23               | 2,24           | 0,03            | 0,00                         | 20,84                | 7,89              | 0,98                  | MADRID       | 30,56      |

| FONDO  | TAA (1) | % DEUDA / VT<br>(2) | DUDOSOS<br>(3) | FALLIDOS<br>(4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD<br>(7) | TASA DE CONCENTRACIÓN |            |            |
|--|---------|---------------------|----------------|-----------------|------------------------------|----------------------|-------------------|-----------------------|------------|------------|
|  |         |                     |                |                 |                              |                      |                   | POR DEUDOR<br>(8)     | GEOGRÁFICA |            |
|  |         |                     |                |                 |                              |                      |                   |                       | ÁREA       | PORCENTAJE |
| BANKINTER 13 FTA   | 2,66    | 51,32               | 1,86           | 0,10            | 0,00                         | 22,37                | 7,18              | 0,79                  | MADRID     | 31,02      |
| BANKINTER 2, FTH   | 4,64    | 29,34               | 1,07           | 0,00            | 0,00                         | 9,60                 | 14,45             | 3,87                  | MADRID     | 29,16      |
| BANKINTER 3, FTH   | 4,18    | 33,96               | 0,76           | 0,00            | 0,00                         | 11,68                | 13,20             | 0,79                  | MADRID     | 24,79      |
| BANKINTER 4, FTH   | 4,16    | 37,04               | 0,44           | 0,00            | 0,00                         | 13,56                | 12,22             | 0,85                  | MADRID     | 31,54      |
| BANKINTER 5, FTH   | 3,70    | 40,60               | 0,73           | 0,00            | 0,00                         | 14,25                | 11,96             | 1,16                  | MADRID     | 27,89      |
| BANKINTER 6, FTA   | 3,73    | 45,18               | 0,83           | 0,01            | 0,00                         | 15,43                | 10,87             | 0,54                  | MADRID     | 26,93      |
| BANKINTER 7, FTH   | 3,89    | 49,10               | 1,67           | 0,02            | 0,00                         | 16,47                | 11,50             | 1,49                  | MADRID     | 23,29      |
| BANKINTER 8, FTA   | 3,48    | 47,37               | 1,22           | 0,00            | 0,00                         | 16,52                | 11,39             | 0,74                  | MADRID     | 25,88      |
| BANKINTER 9, FTA   | 3,23    | 50,10               | 1,23           | 0,01            | 0,00                         | 18,51                | 9,54              | 1,12                  | MADRID     | 30,36      |
| BBVA HIPOTECARIO 3, FTA                                    | 6,56    | 26,27               | 9,20           | 0,32            | 0,00                         | 5,62                 | 9,43              | 8,30                  | ANDALUCÍA  | 22,84      |
| BBVA RMBS 1, FTA   | 1,46    | 77,77               | 1,83           | 1,27            | 0,04                         | 22,82                | 7,75              | 0,28                  | CATALUÑA   | 24,51      |
| BBVA RMBS 10, FTA  | 1,16    | 84,87               | 0,11           | 0,00            | 0,00                         | 33,39                | 2,54              | 0,41                  | MADRID     | 19,83      |
| BBVA RMBS 11, FTA  | 1,11    | 85,99               | 0,13           | 0,00            | 0,00                         | 32,93                | 3,21              | 0,86                  | MADRID     | 22,14      |
| BBVA RMBS 2, FTA   | 1,73    | 64,00               | 2,51           | 0,68            | 0,10                         | 21,47                | 7,80              | 0,15                  | CATALUÑA   | 20,46      |
| BBVA RMBS 3, FTA   | 0,84    | 78,75               | 4,03           | 2,76            | 0,09                         | 27,71                | 6,61              | 0,25                  | CATALUÑA   | 22,96      |
| BBVA RMBS 5 FTA  | 3,53    | 76,41               | 2,95           | 1,21            | 0,11                         | 29,55                | 5,79              | 0,23                  | CATALUÑA   | 20,55      |
| BBVA RMBS 9, FTA   | 2,00    | 82,93               | 0,60           | 0,05            | 0,00                         | 32,10                | 3,96              | 0,48                  | ANDALUCÍA  | 22,50      |
| CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA                                   | 5,13    | 55,25               | 0,99           | 0,00            | 0,00                         | 18,23                | 8,86              | 0,65                  | CATALUÑA   | 98,25      |
| CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA                                   | 5,51    | 48,13               | 0,21           | 0,00            | 0,00                         | 18,34                | 8,31              | 1,15                  | CATALUÑA   | 97,48      |
| CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA                                 | 2,79    | 54,45               | 0,40           | 0,00            | 0,00                         | 23,53                | 7,13              | 2,86                  | CATALUÑA   | 80,13      |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, FTA                         | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 4,33                 | 5,67              | 100,00                | MADRID     | 100,00     |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 5, FTA                         | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 1,42                 | 1,67              | 100,00                | MADRID     | 100,00     |
| CEDULAS TDA 15, FTA  | 34,14   | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 0,42                 | 3,60              | 99,85                 | CATALUÑA   | 42,95      |
| CEDULAS TDA 17, FTA  | 41,03   | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 0,73                 | 3,28              | 100,00                | CATALUÑA   | 43,48      |
| CEDULAS TDA 18, FTA  | 54,80   | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 4,28                 | 2,74              | 100,00                | CATALUÑA   | 56,25      |
| CEDULAS TDA 2, FTA   | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 0,90                 | 9,12              | 97,00                 | CATALUÑA   | 30,25      |
| CEDULAS TDA 21, FONDO DE TITULIZACION                      | 18,46   | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 1,99                 | 2,03              | 100,00                | CATALUÑA   | 41,51      |
| CEDULAS TDA 3, FTA   | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 3,17                 | 8,85              | 97,00                 | CATALUÑA   | 28,75      |
| CEDULAS TDA 5, FTA   | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 6,92                 | 8,11              | 100,00                | ARAGÓN     | 20,00      |
| CEDULAS TDA 6, FTA   | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 12,40                | 7,63              | 100,00                | MADRID     | 21,67      |
| CEDULAS TDA 7, FTA   | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 4,47                 | 7,55              | 98,50                 | CATALUÑA   | 22,50      |
| CM BANCAJA 1, FTA  | 6,68    | 36,49               | 14,77          | 0,00            | 0,00                         | 7,15                 | 8,74              | 50,78                 | CATALUÑA   | 25,18      |
| FTA PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZ. DE CED. HIPOTECARIA | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 0,00                 | 6,50              | 0,00                  | MADRID     | 100,00     |

| FONDO                        | TAA (1) | % DEUDA / VT<br>(2) | DUDOSOS<br>(3) | FALLIDOS<br>(4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD<br>(7) | TASA DE CONCENTRACIÓN |            |            |
|------------------------------|---------|---------------------|----------------|-----------------|------------------------------|----------------------|-------------------|-----------------------|------------|------------|
|                              |         |                     |                |                 |                              |                      |                   | POR DEUDOR<br>(8)     | GEOGRÁFICA |            |
|                              |         |                     |                |                 |                              |                      |                   |                       | ÁREA       | PORCENTAJE |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2  | 1,08    | 70,89               | 2,97           | 0,00            | 0,00                         | 21,00                | 6,00              | 0,90                  | CATALUÑA   | 17,35      |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3  | 0,75    | 74,87               | 5,64           | 1,00            | 0,00                         | 25,00                | 5,00              | 0,66                  | ANDALUCÍA  | 17,06      |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 6  | 1,11    | 82,42               | 9,55           | 1,00            | 1,92                         | 25,00                | 3,00              | 0,83                  | MADRID     | 22,35      |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 7  | 2,04    | 84,64               | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 29,00                | 2,00              | 0,93                  | MADRID     | 24,43      |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 8  | 1,77    | 79,70               | 3,56           | 0,01            | 0,00                         | 26,00                | 1,00              | 1,35                  | MADRID     | 20,52      |
| FTA UCI 11                   | 1,58    | 54,29               | 4,35           | 0,17            | 0,00                         | 18,00                | 8,00              | 1,01                  | ANDALUCÍA  | 21,83      |
| FTA UCI 14                   | 1,56    | 58,93               | 16,53          | 1,01            | 0,00                         | 22,00                | 7,00              | 0,61                  | MADRID     | 22,72      |
| FTA UCI 16                   | 1,58    | 57,95               | 19,36          | 2,09            | 0,00                         | 25,00                | 6,00              | 0,47                  | ANDALUCÍA  | 24,50      |
| FTA UCI 18                   | 7,08    | 58,11               | 9,10           | 2,00            | 50,00                        | 29,00                | 4,00              | 0,00                  | ANDALUCÍA  | 25,45      |
| FTA UCI 6                    | 2,24    | 38,35               | 1,33           | 0,00            | 0,00                         | 12,00                | 12,00             | 0,18                  | MADRID     | 34,28      |
| FTA UCI 7                    | 2,06    | 40,77               | 0,70           | 0,00            | 0,00                         | 13,00                | 11,00             | 0,15                  | ANDALUCÍA  | 53,89      |
| FTA UCI 8                    | 1,59    | 46,08               | 1,11           | 0,00            | 0,00                         | 16,00                | 10,00             | 0,15                  | MADRID     | 86,92      |
| FTA UCI 9                    | 2,03    | 46,86               | 1,62           | 0,00            | 0,00                         | 17,00                | 9,00              | 0,58                  | ANDALUCÍA  | 22,64      |
| FTA, HIPOTEBANSA 11          | 2,89    | 41,01               | 0,70           | 0,00            | 0,00                         | 13,00                | 10,00             | 1,25                  | CATALUÑA   | 23,10      |
| FTA, HIPOTEBANSA X           | 2,84    | 36,26               | 0,88           | 0,00            | 0,00                         | 10,00                | 10,00             | 1,42                  | CATALUÑA   | 25,17      |
| FTA, UCI 15                  | 1,43    | 60,28               | 14,28          | 1,23            | 0,00                         | 25,00                | 6,00              | 0,67                  | ANDALUCÍA  | 22,15      |
| FTA, UCI 17                  | 5,13    | 63,44               | 7,57           | 5,00            | 41,00                        | 27,00                | 5,00              | 0,00                  | ANDALUCÍA  | 24,40      |
| FTH UCI 10                   | 2,20    | 46,69               | 1,70           | 0,00            | 0,00                         | 18,00                | 8,00              | 1,65                  | MADRID     | 98,65      |
| FTH UCI 12                   | 1,47    | 50,43               | 6,95           | 0,37            | 0,00                         | 21,00                | 7,00              | 0,88                  | ANDALUCÍA  | 23,11      |
| FTH UCI 5                    | 1,91    | 34,89               | 1,23           | 0,00            | 0,00                         | 11,00                | 13,00             | 0,28                  | MADRID     | 29,33      |
| GAT ICO-FTVPO 1, FTH         | 3,45    | 47,64               | 0,53           | 0,17            | 0,00                         | 11,57                | 8,79              | 0,71                  | CATALUÑA   | 75,11      |
| GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA | 2,96    | 52,78               | 3,82           | 7,36            | 0,33                         | 20,50                | 6,67              | 2,38                  | CATALUÑA   | 25,88      |
| GC SABADELL 1, FTH           | 4,93    | 40,61               | 0,77           | 0,59            | 18,52                        | 13,19                | 11,10             | 0,94                  | CATALUÑA   | 38,90      |
| HIPOCAT 10, FTA              | 1,91    | 68,84               | 8,65           | 3,97            | 28,72                        | 20,52                | 7,97              | 0,82                  | CATALUÑA   | 70,85      |
| HIPOCAT 11, FTA              | 1,65    | 71,09               | 9,60           | 7,41            | 21,86                        | 22,38                | 7,35              | 0,93                  | CATALUÑA   | 70,54      |
| HIPOCAT 14, FTA              | 5,23    | 49,17               | 2,64           | 0,91            | 18,92                        | 16,89                | 7,65              | 1,21                  | CATALUÑA   | 85,34      |
| HIPOCAT 16, FTA              | 4,07    | 48,59               | 0,57           | 0,06            | 52,97                        | 17,37                | 8,20              | 0,87                  | CATALUÑA   | 58,55      |
| HIPOCAT 17, FTA              | 2,29    | 54,28               | 5,18           | 0,82            | 26,55                        | 23,59                | 6,48              | 1,29                  | CATALUÑA   | 60,22      |
| HIPOCAT 18, FTA              | 2,36    | 68,08               | 1,20           | 0,13            | 35,54                        | 21,51                | 7,22              | 1,01                  | CATALUÑA   | 47,46      |
| HIPOCAT 19, FTA              | 1,97    | 64,23               | 5,25           | 1,18            | 19,88                        | 23,46                | 6,78              | 1,10                  | CATALUÑA   | 68,01      |
| HIPOCAT 20, FTA              | 2,48    | 65,25               | 3,59           | 0,25            | 15,45                        | 22,50                | 6,59              | 0,82                  | CATALUÑA   | 73,08      |
| HIPOCAT 4, FTA               | 3,36    | 47,93               | 0,91           | 0,00            | 0,00                         | 12,23                | 14,17             | 0,07                  | CATALUÑA   | 86,46      |
| HIPOCAT 5, FTA               | 3,15    | 59,39               | 1,11           | 0,05            | 0,00                         | 13,94                | 13,42             | 1,19                  | CATALUÑA   | 85,93      |

| FONDO                                 | TAA (1) | % DEUDA / VT<br>(2) | DUDOSOS<br>(3) | FALLIDOS<br>(4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD<br>(7) | TASA DE CONCENTRACIÓN |            |            |
|---------------------------------------|---------|---------------------|----------------|-----------------|------------------------------|----------------------|-------------------|-----------------------|------------|------------|
|                                       |         |                     |                |                 |                              |                      |                   | POR DEUDOR<br>(8)     | GEOGRÁFICA |            |
|                                       |         |                     |                |                 |                              |                      |                   |                       | ÁREA       | PORCENTAJE |
| HIPOCAT 6, FTA                        | 2,45    | 64,89               | 2,35           | 0,09            | 0,00                         | 16,32                | 11,93             | 1,12                  | CATALUÑA   | 83,64      |
| HIPOCAT 7, FTA                        | 1,92    | 64,69               | 3,84           | 0,84            | 33,39                        | 17,96                | 10,24             | 0,65                  | CATALUÑA   | 70,52      |
| HIPOCAT 8, FTA                        | 2,65    | 60,69               | 4,55           | 1,40            | 18,89                        | 18,14                | 9,62              | 0,60                  | CATALUÑA   | 82,54      |
| HIPOCAT 9, FTA                        | 2,69    | 64,60               | 6,19           | 1,79            | 26,23                        | 19,85                | 8,34              | 1,07                  | CATALUÑA   | 68,85      |
| IM BANCO POPULAR MBS 2, FTA           | 1,66    | 80,59               | 3,08           | 0,00            | 0,00                         | 25,44                | 5,70              | 1,50                  | ANDALUCÍA  | 32,91      |
| IM BANKOA MBS 1, FTA                  | 3,33    | 54,06               | 2,41           | 0,00            | 0,00                         | 20,76                | 7,03              | 4,16                  | PAÍS VASCO | 88,45      |
| IM BCG RMBS 1, FTA                    | 2,18    | 56,92               | 0,26           | 0,00            | 0,00                         | 26,87                | 5,76              | 1,12                  | GALICIA    | 25,46      |
| IM CAJA LABORAL 1, FTA                | 4,29    | 50,27               | 0,76           | 0,00            | 0,00                         | 16,39                | 9,71              | 0,56                  | PAÍS VASCO | 44,00      |
| IM CAJA LABORAL 2, FTA                | 1,77    | 81,32               | 3,20           | 0,00            | 0,00                         | 28,80                | 6,54              | 0,66                  | PAÍS VASCO | 44,11      |
| IM CAJAMAR 1, FTA                     | 2,93    | 48,15               | 2,13           | 0,00            | 0,00                         | 15,66                | 9,07              | 1,82                  | ANDALUCÍA  | 41,87      |
| IM CAJAMAR 3, FTA                     | 2,52    | 51,29               | 4,05           | 0,00            | 0,00                         | 18,60                | 7,96              | 0,72                  | ANDALUCÍA  | 38,41      |
| IM CAJAMAR 4, FTA                     | 2,37    | 54,61               | 3,43           | 0,00            | 0,00                         | 19,77                | 7,26              | 0,72                  | ANDALUCÍA  | 40,57      |
| IM CAJAMAR 5, FTA                     | 2,79    | 55,20               | 5,20           | 0,00            | 0,00                         | 20,05                | 6,84              | 0,84                  | ANDALUCÍA  | 45,85      |
| IM CAJAMAR 6, FTA                     | 2,65    | 58,75               | 6,16           | 0,00            | 0,00                         | 23,12                | 6,11              | 0,56                  | ANDALUCÍA  | 39,23      |
| IM CAJASTUR MBS 1, FTA                | 1,48    | 71,71               | 1,89           | 0,00            | 0,00                         | 22,69                | 6,03              | 5,15                  | ASTURIAS   | 68,92      |
| IM CEDULAS 1 GRUPO BANCO POPULAR, FTA | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 1,17                 | 8,83              | 100,00                | MADRID     | 100,00     |
| IM CEDULAS 10, FTA                    | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 9,17                 | 5,83              | 100,00                | CATALUÑA   | 50,00      |
| IM CEDULAS 14, FTA                    | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 2,25                 | 2,75              | 100,00                | MADRID     | 75,00      |
| IM CEDULAS 15, FTA                    | 50,00   | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 1,00                 | 2,00              | 100,00                | MADRID     | 50,00      |
| IM CEDULAS 2, FTA                     | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 1,50                 | 8,50              | 100,00                | PAÍS VASCO | 33,90      |
| IM CEDULAS 3, FTA                     | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 1,92                 | 8,08              | 100,00                | ANDALUCÍA  | 47,17      |
| IM CEDULAS 4, FTA                     | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 2,25                 | 7,75              | 100,00                | MADRID     | 40,96      |
| IM CEDULAS 5, FTA                     | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 7,50                 | 7,50              | 100,00                | PAÍS VASCO | 40,00      |
| IM CEDULAS 7, FTA                     | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 8,25                 | 6,75              | 100,00                | PAÍS VASCO | 50,00      |
| IM CEDULAS 9, FTA                     | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 3,50                 | 6,50              | 100,00                | ANDALUCÍA  | 39,22      |
| IM CFS RMBS 1, FTA                    | 0,43    | 58,76               | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 18,92                | 9,19              | 1,22                  | ANDALUCÍA  | 28,70      |
| IM PASTOR 2, FTH                      | 5,21    | 40,70               | 1,70           | 0,00            | 0,00                         | 13,86                | 10,38             | 1,41                  | CATALUÑA   | 27,06      |
| IM PASTOR 3, FTH                      | 2,80    | 52,56               | 16,82          | 0,00            | 0,00                         | 18,56                | 8,46              | 2,19                  | CATALUÑA   | 36,06      |
| IM PASTOR 4, FTA                      | 3,00    | 53,14               | 14,25          | 0,00            | 0,00                         | 20,07                | 7,52              | 1,63                  | CATALUÑA   | 24,65      |
| IM SABADELL RMBS 2, FTA               | 4,81    | 47,26               | 2,37           | 0,00            | 0,00                         | 17,81                | 7,76              | 0,78                  | CATALUÑA   | 43,20      |
| IM SABADELL RMBS 3, FTA               | 4,77    | 54,72               | 2,86           | 0,00            | 0,00                         | 19,39                | 6,56              | 1,09                  | CATALUÑA   | 46,11      |
| IM TERRASSA MBS 1, FTA                | 3,62    | 72,39               | 7,97           | 0,00            | 0,00                         | 23,46                | 7,97              | 4,93                  | CATALUÑA   | 99,42      |
| INTERMONEY MASTER CEDULAS, FTA        | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 3,00                 | 7,08              | 100,00                | PAÍS VASCO | 30,21      |

| FONDO                           | TAA (1) | % DEUDA / VT<br>(2) | DUDOSOS<br>(3) | FALLIDOS<br>(4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD<br>(7) | TASA DE CONCENTRACIÓN |              |            |
|---------------------------------|---------|---------------------|----------------|-----------------|------------------------------|----------------------|-------------------|-----------------------|--------------|------------|
|                                 |         |                     |                |                 |                              |                      |                   | POR DEUDOR<br>(8)     | GEOGRÁFICA   |            |
|                                 |         |                     |                |                 |                              |                      |                   |                       | ÁREA         | PORCENTAJE |
| MADRID ICO-FTVPO I, FTA         | 3,39    | 57,37               | 0,39           | 0,19            | 0,00                         | 18,58                | 7,44              | 2,33                  | MADRID       | 47,05      |
| MADRID RESIDENCIAL I, FTA       | 4,61    | 80,48               | 3,24           | 1,02            | 0,00                         | 26,27                | 5,97              | 1,33                  | MADRID       | 51,86      |
| MADRID RESIDENCIAL II, FTA      | 4,28    | 85,82               | 2,51           | 0,30            | 0,00                         | 27,24                | 5,80              | 1,49                  | MADRID       | 51,12      |
| MADRID RMBS I, FTA              | 4,27    | 83,44               | 4,72           | 4,13            | 0,00                         | 21,75                | 7,72              | 0,50                  | MADRID       | 68,38      |
| MADRID RMBS II, FTA             | 4,32    | 82,46               | 5,09           | 4,40            | 0,00                         | 21,70                | 7,72              | 0,60                  | MADRID       | 67,61      |
| MADRID RMBS III FTA             | 3,68    | 83,47               | 5,92           | 4,51            | 0,01                         | 24,89                | 7,09              | 0,00                  | MADRID       | 61,30      |
| MADRID RMBS IV, FTA             | 5,51    | 81,12               | 5,08           | 5,32            | 0,04                         | 25,40                | 6,63              | 0,70                  | MADRID       | 63,19      |
| MBS BANCAJA 1 FTA               | 4,38    | 35,84               | 4,45           | 0,02            | 0,00                         | 10,13                | 10,49             | 2,29                  | C.VALENCIANA | 71,25      |
| MBS BANCAJA 2, FTA              | 4,05    | 46,57               | 5,88           | 0,17            | 0,00                         | 14,75                | 8,63              | 2,50                  | C.VALENCIANA | 63,03      |
| MBS BANCAJA 3, FTA              | 4,29    | 49,73               | 6,46           | 0,50            | 0,05                         | 16,85                | 7,80              | 1,26                  | C.VALENCIANA | 47,13      |
| MBS BANCAJA 4, FTA              | 3,85    | 49,54               | 8,17           | 0,58            | 0,02                         | 17,78                | 7,00              | 0,70                  | C.VALENCIANA | 45,20      |
| MBS BANCAJA 6, FTA              | 4,94    | 55,21               | 7,38           | 0,32            | 0,02                         | 22,29                | 4,99              | 0,97                  | C.VALENCIANA | 51,44      |
| MBS BANCAJA 7, FTA              | 3,95    | 83,04               | 8,42           | 0,36            | 0,00                         | 32,13                | 4,63              | 0,81                  | C.VALENCIANA | 41,60      |
| MBS BANCAJA 8, FTA              | 3,06    | 80,49               | 8,66           | 0,19            | 0,00                         | 31,94                | 3,98              | 1,60                  | C.VALENCIANA | 39,47      |
| MBSCAT 1, FTA                   | 1,94    | 51,86               | 4,45           | 1,33            | 30,84                        | 21,53                | 6,53              | 1,01                  | CATALUÑA     | 69,89      |
| MBSCAT 2, FTA                   | 14,71   | 46,14               | 10,27          | 2,55            | 20,03                        | 16,24                | 5,73              | 8,88                  | CATALUÑA     | 69,72      |
| PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA       | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 11,74                | 6,84              | 75,05                 | ANDALUCÍA    | 29,53      |
| RURAL CEDULA I, FTA             | 0,00    | 0,00                | 0,00           | 0,00            | 0,00                         | 4,20                 | 0,81              | 100,00                | ANDALUCÍA    | 50,00      |
| RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA | 3,60    | 48,28               | 4,88           | 0,07            | 0,07                         | 15,14                | 8,75              | 1,16                  | C.VALENCIANA | 47,63      |
| RURAL HIPOTECARIO II FTH        | 5,87    | 26,78               | 2,43           | 0,00            | 0,00                         | 7,24                 | 13,46             | 4,40                  | ANDALUCÍA    | 32,69      |
| RURAL HIPOTECARIO III FTH       | 4,33    | 31,55               | 1,91           | 0,00            | 0,00                         | 9,07                 | 12,36             | 2,37                  | ANDALUCÍA    | 35,44      |
| RURAL HIPOTECARIO IV FTH        | 4,31    | 38,70               | 2,23           | 0,02            | 0,00                         | 11,67                | 11,48             | 1,83                  | ANDALUCÍA    | 33,21      |
| RURAL HIPOTECARIO IX, FTA       | 3,50    | 56,55               | 6,73           | 0,35            | 0,12                         | 20,11                | 7,16              | 0,46                  | C.VALENCIANA | 33,31      |
| RURAL HIPOTECARIO V FTA         | 4,02    | 41,42               | 1,91           | 0,00            | 0,00                         | 13,54                | 10,58             | 0,99                  | ANDALUCÍA    | 15,14      |
| RURAL HIPOTECARIO VI, FTA       | 4,14    | 46,52               | 2,89           | 0,01            | 0,00                         | 14,85                | 9,73              | 0,87                  | ANDALUCÍA    | 26,81      |
| RURAL HIPOTECARIO VII, FTA      | 4,16    | 45,76               | 3,11           | 0,01            | 0,00                         | 15,19                | 9,53              | 0,69                  | ANDALUCÍA    | 36,41      |
| RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA     | 4,19    | 49,47               | 4,17           | 0,09            | 0,84                         | 17,49                | 8,28              | 0,53                  | ANDALUCÍA    | 31,79      |
| RURAL HIPOTECARIO X, FTA        | 4,46    | 55,94               | 4,53           | 0,12            | 0,00                         | 22,04                | 6,25              | 0,37                  | C.VALENCIANA | 29,84      |
| RURAL HIPOTECARIO XI, FTA       | 3,64    | 55,91               | 4,85           | 0,07            | 0,00                         | 22,19                | 5,96              | 0,29                  | C.VALENCIANA | 30,85      |
| RURAL HIPOTECARIO XII, FTA      | 2,80    | 55,85               | 4,52           | 0,01            | 0,00                         | 22,00                | 5,69              | 0,55                  | C.LA MANCHA  | 33,76      |
| SANTANDER HIPOTECARIO I, FTA    | 2,22    | 60,28               | 1,04           | 0,00            | 0,00                         | 16,00                | 8,00              | 1,00                  | CATALUÑA     | 28,96      |
| SOL-LION, FTA                   | 3,48    | 46,55               | 0,60           | 0,00            | 0,00                         | 20,04                | 6,41              | 0,29                  | MADRID       | 32,90      |
| TDA 11, FTH                     | 3,60    | 30,37               | 1,51           | 0,00            | 0,00                         | 8,35                 | 14,67             | 0,00                  | CATALUÑA     | 68,76      |

| FONDO               | TAA (1) | % DEUDA / VT<br>(2) | DUDOSOS<br>(3) | FALLIDOS<br>(4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD<br>(7) | TASA DE CONCENTRACIÓN |              |            |
|---------------------|---------|---------------------|----------------|-----------------|------------------------------|----------------------|-------------------|-----------------------|--------------|------------|
|                     |         |                     |                |                 |                              |                      |                   | POR DEUDOR<br>(8)     | GEOGRÁFICA   |            |
|                     |         |                     |                |                 |                              |                      |                   |                       | ÁREA         | PORCENTAJE |
| TDA 12, FTH         | 3,99    | 31,68               | 1,02           | 0,00            | 0,00                         | 8,44                 | 14,07             | 0,00                  | C.LA MANCHA  | 24,32      |
| TDA 13 - MIXTO, FTA | 3,58    | 37,93               | 1,04           | 0,00            | 0,00                         | 9,71                 | 13,78             | 0,00                  | CATALUÑA     | 59,31      |
| TDA 14 - MIXTO, FTA | 3,83    | 40,86               | 0,85           | 0,00            | 0,00                         | 10,80                | 12,85             | 0,00                  | CATALUÑA     | 48,35      |
| TDA 15 - MIXTO, FTA | 3,80    | 47,78               | 1,82           | 0,00            | 0,00                         | 13,07                | 12,01             | 0,00                  | CATALUÑA     | 39,40      |
| TDA 16 - MIXTO, FTA | 2,44    | 48,24               | 2,89           | 0,12            | 0,00                         | 13,92                | 10,93             | 0,00                  | ANDALUCÍA    | 50,05      |
| TDA 17 - MIXTO, FTA | 3,29    | 40,29               | 3,22           | 0,00            | 0,00                         | 12,36                | 10,91             | 0,00                  | BALEARES     | 37,71      |
| TDA 18 - MIXTO, FTA | 3,17    | 51,45               | 2,21           | 0,00            | 0,00                         | 16,46                | 10,00             | 0,00                  | CATALUÑA     | 42,31      |
| TDA 19 - MIXTO, FTA | 2,87    | 47,55               | 1,80           | 0,00            | 0,00                         | 14,61                | 10,36             | 0,00                  | CATALUÑA     | 43,77      |
| TDA 20 - MIXTO, FTA | 4,80    | 49,47               | 0,70           | 0,00            | 0,00                         | 15,16                | 10,62             | 0,00                  | CATALUÑA     | 40,16      |
| TDA 22 - MIXTO, FTA | 2,20    | 58,74               | 7,55           | 0,38            | 0,00                         | 18,26                | 9,97              | 0,00                  | CATALUÑA     | 41,00      |
| TDA 23, FTA         | 3,54    | 52,06               | 6,59           | 0,01            | 0,00                         | 17,36                | 9,61              | 0,00                  | CATALUÑA     | 47,57      |
| TDA 24, FTA         | 2,45    | 51,79               | 12,35          | 1,32            | 0,00                         | 16,87                | 9,33              | 0,97                  | C.LA MANCHA  | 54,09      |
| TDA 25, FTA         | 0,81    | 64,33               | 28,82          | 4,39            | 0,00                         | 21,36                | 7,89              | 1,70                  | ANDALUCÍA    | 35,61      |
| TDA 26 - MIXTO, FTA | 3,54    | 48,94               | 3,65           | 0,00            | 0,00                         | 17,45                | 8,16              | 1,46                  | BALEARES     | 24,61      |
| TDA 27, FTA         | 3,44    | 52,29               | 10,96          | 1,91            | 0,17                         | 20,92                | 8,05              | 0,00                  | ANDALUCÍA    | 34,92      |
| TDA 28, FTA         | 2,42    | 62,13               | 24,04          | 4,94            | 0,00                         | 26,51                | 7,30              | 1,55                  | CATALUÑA     | 55,35      |
| TDA 29, FTA         | 3,56    | 56,69               | 4,80           | 0,01            | 0,00                         | 21,96                | 7,03              | 1,16                  | BALEARES     | 29,86      |
| TDA 30, FTA         | 2,45    | 57,19               | 2,14           | 0,00            | 0,00                         | 23,18                | 6,51              | 1,65                  | BALEARES     | 48,55      |
| TDA 31, FTA         | 4,49    | 56,21               | 8,43           | 0,03            | 0,00                         | 21,55                | 6,14              | 2,96                  | C.VALENCIANA | 24,43      |
| TDA CAJAMAR 2, FTA  | 2,87    | 48,95               | 2,92           | 0,00            | 0,00                         | 16,46                | 8,65              | 0,00                  | ANDALUCÍA    | 45,38      |
| TDA CAM 1, FTA      | 2,98    | 39,83               | 2,44           | 0,00            | 0,00                         | 9,97                 | 12,04             | 0,00                  | C.VALENCIANA | 56,50      |
| TDA CAM 10, FTA     | 5,67    | 66,26               | 12,89          | 0,00            | 0,00                         | 26,72                | 6,12              | 0,88                  | C.VALENCIANA | 38,94      |
| TDA CAM 11, FTA     | 3,33    | 63,28               | 8,35           | 0,00            | 0,00                         | 28,50                | 5,33              | 0,70                  | C.VALENCIANA | 36,64      |
| TDA CAM 12, FTA     | 3,10    | 58,99               | 6,83           | 0,00            | 0,00                         | 25,35                | 6,21              | 0,88                  | C.VALENCIANA | 33,73      |
| TDA CAM 2, FTA      | 2,89    | 40,04               | 3,37           | 0,00            | 0,00                         | 10,83                | 11,49             | 0,60                  | C.VALENCIANA | 47,06      |
| TDA CAM 3, FTA      | 3,10    | 39,87               | 3,14           | 0,00            | 0,00                         | 10,45                | 11,66             | 0,59                  | C.VALENCIANA | 65,50      |
| TDA CAM 4, FTA      | 2,90    | 44,51               | 4,01           | 0,00            | 0,00                         | 12,83                | 10,18             | 0,00                  | C.VALENCIANA | 59,26      |
| TDA CAM 5, FTA      | 3,19    | 55,82               | 7,04           | 0,00            | 0,00                         | 18,77                | 9,00              | 0,00                  | C.VALENCIANA | 40,26      |
| TDA CAM 6, FTA      | 3,48    | 60,42               | 10,29          | 0,00            | 0,00                         | 20,77                | 7,96              | 0,36                  | C.VALENCIANA | 44,52      |
| TDA CAM 7, FTA      | 3,46    | 61,22               | 9,77           | 0,00            | 0,00                         | 21,79                | 7,68              | 0,57                  | C.VALENCIANA | 38,77      |
| TDA CAM 8, FTA      | 3,53    | 55,31               | 8,76           | 0,00            | 0,00                         | 19,78                | 8,24              | 0,66                  | C.VALENCIANA | 45,39      |
| TDA CAM 9, FTA      | 3,48    | 58,52               | 11,79          | 0,00            | 0,00                         | 22,94                | 6,69              | 0,85                  | C.VALENCIANA | 44,78      |
| TDA IBERCAJA 1, FTA | 4,00    | 43,69               | 0,20           | 0,00            | 0,00                         | 10,97                | 11,97             | 0,80                  | MADRID       | 33,25      |

| FONDO                                   | TAA (1)     | % DEUDA / VT<br>(2) | DUDOSOS<br>(3) | FALLIDOS<br>(4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD<br>(7) | TASA DE CONCENTRACIÓN |              |              |
|---|-------------|---------------------|----------------|-----------------|------------------------------|----------------------|-------------------|-----------------------|--------------|--------------|
|   |             |                     |                |                 |                              |                      |                   | POR DEUDOR<br>(8)     | GEOGRÁFICA   |              |
|   |             |                     |                |                 |                              |                      |                   |                       | ÁREA         | PORCENTAJE   |
| TDA IBERCAJA 2, FTA                     | 3,19        | 50,70               | 0,40           | 0,04            | 0,00                         | 15,13                | 10,04             | 0,59                  | MADRID       | 30,39        |
| TDA IBERCAJA 3, FTA                     | 3,73        | 52,74               | 0,71           | 0,07            | 0,13                         | 18,05                | 8,69              | 0,50                  | MADRID       | 36,55        |
| TDA IBERCAJA 4, FTA                     | 3,82        | 54,85               | 1,02           | 0,33            | 1,97                         | 18,67                | 8,38              | 0,62                  | MADRID       | 31,59        |
| TDA IBERCAJA 5, FTA                     | 3,11        | 58,62               | 1,14           | 0,32            | 0,07                         | 20,01                | 8,06              | 0,51                  | MADRID       | 30,22        |
| TDA IBERCAJA 6, FTA                     | 3,86        | 59,29               | 2,02           | 0,60            | 0,00                         | 22,25                | 7,42              | 0,48                  | MADRID       | 32,34        |
| TDA IBERCAJA 7, FTA                     | 2,85        | 61,79               | 0,67           | 0,02            | 0,00                         | 25,73                | 5,86              | 0,38                  | MADRID       | 34,03        |
| TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH             | 3,16        | 56,16               | 49,51          | 0,00            | 0,00                         | 14,29                | 6,64              | 0,40                  | MADRID       | 43,83        |
| TDA PASTOR 1, FTA                       | 4,20        | 35,40               | 0,27           | 0,00            | 0,00                         | 10,95                | 13,86             | 0,00                  | MADRID       | 24,77        |
| TDA TARRAGONA 1, FTA                    | 2,05        | 64,03               | 10,12          | 1,03            | 0,08                         | 24,02                | 7,86              | 1,14                  | CATALUÑA     | 94,39        |
| UNICAJA ANDALUCIA FTVIVIENDA TDA 1, FTA | 3,82        | 51,66               | 33,45          | 0,00            | 0,00                         | 15,81                | 8,34              | 2,98                  | ANDALUCÍA    | 99,71        |
| UNICAJA TDA VPO, FTA                    | 1,17        | 57,39               | 66,31          | 0,00            | 0,00                         | 14,49                | 7,11              | 1,37                  | ANDALUCÍA    | 86,62        |
| VAL BANCAJA 1, FTA                      | 3,21        | 64,16               | 4,66           | 0,21            | 0,00                         | 28,54                | 4,95              | 3,08                  | C.VALENCIANA | 53,41        |
| VALENCIA HIPOTECARIO 1, FTA             | 3,20        | 36,61               | 1,62           | 0,00            | 0,00                         | 10,29                | 11,56             | 1,40                  | C.VALENCIANA | 61,69        |
| VALENCIA HIPOTECARIO 2, FTH             | 4,06        | 45,39               | 5,04           | 0,26            | 0,00                         | 14,58                | 9,01              | 0,89                  | C.VALENCIANA | 65,15        |
| VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA             | 3,84        | 50,78               | 4,97           | 0,28            | 0,00                         | 17,10                | 7,98              | 1,06                  | C.VALENCIANA | 70,27        |
| VALENCIA HIPOTECARIO 4, FTA             | 3,86        | 59,50               | 11,89          | 2,09            | 0,00                         | 21,75                | 6,37              | 0,66                  | C.VALENCIANA | 61,87        |
| VALENCIA HIPOTECARIO 5, FTA             | 3,21        | 62,74               | 10,24          | 0,78            | 0,04                         | 24,26                | 5,30              | 1,05                  | C.VALENCIANA | 66,06        |
| <b>Medias</b>                           | <b>2,77</b> | <b>31,09</b>        | <b>2,39</b>    | <b>0,37</b>     | <b>1,34</b>                  | <b>14,09</b>         | <b>6,78</b>       | <b>33,52</b>          |              | <b>35,75</b> |

**Información sobre los encabezados**

(1) Tasa de amortización anticipada

(2) Porcentaje que representa la deuda total sobre el valor de tasación de la garantía

(3) Tasa de dudosos: cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos y el principal pendiente del total activos

(4) Tasa de fallidos: cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en balance más el principal de los activos clasificados como fallidos

(5) Tasa de recuperación de fallidos: cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de los fallidos al cierre del mismo periodo del año anterior.

(6) Vida residual media ponderada valorada en años

(7) Antigüedad media ponderada valorada en años

(8) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración



| FONDO                                | TAA (1) | % DEUDA /<br>VT (2) | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD (7) | POR DEUDOR (8) | TASA DE CONCENTRACIÓN   |            |
|--------------------------------------|---------|---------------------|-------------|--------------|------------------------------|----------------------|----------------|----------------|---|------------|
|                                      |         |                     |             |              |                              |                      |                |                | GEOGRÁFICA  |            |
|                                      |         |                     |             |              |                              |                      |                |                | ÁREA  | PORCENTAJE |
| AYT ANDALUCIA FTEMPRESA CAJAMAR, FTA | 4,07    | 39,18               | 10,88       | 0,00         | 0,00                         | 8,93                 | 4,58           | 13,23          | 01.AGRICULTURA, GANADERÍA,<br>CAZA Y SERVICIOS<br>RELACIONADOS CON LAS MISMAS                                 | 19,10      |
| AYT CAIXA GALICIA EMPRESAS I, FTA    | 6,50    | 39,54               | 8,31        | 0,00         | 0,00                         | 9,12                 | 7,48           | 14,19          | 55.SERVICIOS DE ALOJAMIENTO   | 17,07      |
| AYT CAIXANOVA FTPYME I, FTA          | 7,68    | 25,42               | 10,57       | 0,00         | 0,00                         | 4,97                 | 5,85           | 17,44          | 51.TRANSPORTE AÉREO   | 13,66      |
| AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FTA | 17,08   | 0,00                | 9,11        | 0,00         | 0,00                         | 9,25                 | 6,44           | 17,93          | 78.ACTIVIDADES RELACIONADAS<br>CON EL EMPLEO  | 0,00       |
| AYT FONDO EOLICO, FTA                | 0,00    | 0,00                | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 2,60                 | 7,12           | 100,00         | 31.FABRICACIÓN DE MUEBLES   | 49,67      |
| AYT FTPYME II, FTA                   | 5,85    | 47,26               | 6,18        | 0,00         | 0,00                         | 9,31                 | 10,54          | 10,85          | 52.ALMACENAMIENTO Y<br>ACTIVIDADES ANEXAS AL<br>TRANSPORTE  | 16,88      |
| BANCAJA LEASING 1, FTA               | 1,16    | 0,00                | 11,36       | 0,00         | 0,00                         | 8,90                 | 6,01           | 9,86           | 35.SUMINISTRO DE ENERGÍA<br>ELÉCTRICA, GAS, VAPOR Y AIRE<br>ACONDICIONADO                                     | 36,65      |
| BANKINTER 2 PYME FTA                 | 3,13    | 33,88               | 7,64        | 1,15         | 0,00                         | 8,70                 | 8,64           | 7,11           | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS  | 32,78      |
| BANKINTER 3 FTPYME FTA               | 2,85    | 40,51               | 9,46        | 0,15         | 0,00                         | 10,58                | 6,94           | 4,98           | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS  | 24,01      |
| BANKINTER 4 FTPYME, FTA              | 1,30    | 43,03               | 11,36       | 0,37         | 0,00                         | 11,07                | 5,82           | 11,15          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS  | 19,72      |
| BBVA EMPRESAS 1, FTA                 | 3,03    | 33,37               | 10,44       | 0,14         | 0,00                         | 5,52                 | 7,05           | 35,00          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS  | 17,89      |
| BBVA EMPRESAS 2, FTA                 | 6,79    | 42,48               | 5,98        | 0,03         | 0,10                         | 7,60                 | 6,03           | 16,73          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS  | 14,98      |
| BBVA EMPRESAS 3, FTA                 | 9,45    | 42,32               | 22,14       | 0,30         | 0,06                         | 6,68                 | 4,21           | 9,71           | 41.CONSTRUCCIÓN DE EDIFICIOS  | 14,89      |
| BBVA EMPRESAS 4, FTA                 | 12,21   | 40,15               | 13,44       | 0,12         | 0,00                         | 6,63                 | 3,89           | 16,80          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS  | 15,75      |
| BBVA EMPRESAS 5, FTA                 | 6,75    | 44,32               | 7,47        | 0,00         | 0,00                         | 6,76                 | 4,02           | 21,00          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS  | 14,93      |
| BBVA EMPRESAS 6, FTA                 | 8,13    | 45,32               | 7,26        | 0,00         | 0,00                         | 7,87                 | 3,08           | 17,67          | 41.CONSTRUCCIÓN DE EDIFICIOS  | 14,18      |
| BBVA LEASING 1, FTA                  | 2,94    | 0,00                | 30,12       | 0,17         | 0,00                         | 5,59                 | 7,39           | 5,50           | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS  | 20,64      |
| BBVA-3 FTPYME FTA                    | 9,46    | 24,49               | 11,86       | 0,00         | 0,00                         | 4,31                 | 9,80           | 18,55          | 46.COMERCIO AL POR MAYOR E<br>INTERMEDIARIOS DEL COMERCIO,<br>EXCEPTO DE VEHÍCULOS DE<br>MOTOR Y MOTOCICLETAS | 17,70      |
| BBVA-4 PYME, FTA                     | 8,82    | 29,42               | 21,06       | 3,13         | 0,00                         | 5,34                 | 8,50           | 24,50          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS  | 15,39      |
| BBVA-5 FTPYME, FTA                   | 6,00    | 31,98               | 23,54       | 0,24         | 0,00                         | 5,49                 | 8,07           | 12,83          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS  | 20,69      |

| FONDO                               | TAA (1) | % DEUDA / |       | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD (7) | POR DEUDOR (8)   | TASA DE CONCENTRACIÓN |            |
|-------------------------------------|---------|-----------|-------|-------------|--------------|------------------------------|----------------------|----------------|--|-----------------------|------------|
|                                     |         |           |       |             |              |                              |                      |                |  | GEOGRÁFICA            |            |
|                                     |         |           |       |             |              |                              |                      |                |  | ÁREA                  | PORCENTAJE |
| BBVA-6 FTPYME FTA                   | 7,18    | 36,60     | 24,51 | 0,28        | 0,00         | 6,20                         | 7,26                 | 10,34          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 16,74                 |            |
| BBVA-7 FTGENCAT, FTA                | 3,35    | 37,57     | 19,66 | 0,24        | 0,00         | 7,12                         | 6,50                 | 29,87          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 31,18                 |            |
| BBVA-8 FTPYME FTA                   | 4,09    | 38,76     | 17,52 | 0,26        | 0,00         | 7,01                         | 5,57                 | 14,24          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 12,98                 |            |
| BBVA-9 PYME FTA                     | 7,90    | 50,05     | 0,00  | 0,00        | 0,00         | 5,94                         | 1,92                 | 6,55           | 46.COMERCIO AL POR MAYOR E INTERMEDIARIOS DEL COMERCIO, EXCEPTO DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS | 9,96                  |            |
| CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA  | 12,17   | 49,16     | 4,44  | 0,00        | 0,00         | 16,44                        | 7,25                 | 6,15           | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL             | 22,35                 |            |
| CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA      | 11,26   | 42,60     | 5,88  | 0,00        | 0,00         | 12,21                        | 8,12                 | 5,71           | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL             | 34,15                 |            |
| CIBELES III FTPYME, FTA             | 4,93    | 31,09     | 7,19  | 0,00        | 0,00         | 7,15                         | 10,80                | 9,83           | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL             | 53,08                 |            |
| EDT FTPYME PASTOR 3, FTA            | 10,86   | 35,92     | 37,00 | 2,09        | 0,00         | 8,69                         | 8,06                 | 30,53          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 39,28                 |            |
| EMPRESAS BANESTO 2, FTA             | 6,51    | 46,49     | 7,33  | 1,45        | 55,00        | 7,00                         | 4,00                 | 46,00          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 14,00                 |            |
| EMPRESAS BANESTO 5, FTA             | 4,31    | 36,73     | 6,20  | 0,00        | 0,00         | 6,00                         | 2,00                 | 25,59          | -  | 18,06                 |            |
| EMPRESAS BANESTO 6, FTA             | 2,13    | 0,00      | 1,73  | 0,00        | 0,00         | 2,00                         | 2,00                 | 24,34          | 06.EXTRACCIÓN DE CRUDO DE PETRÓLEO Y GAS NATURAL   | 7,52                  |            |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 3, FTA | 5,37    | 35,50     | 25,66 | 0,00        | 0,00         | 8,04                         | 8,74                 | 31,03          | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL             | 41,38                 |            |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 5, FTA | 3,29    | 44,22     | 17,26 | 0,00        | 0,00         | 11,27                        | 7,56                 | 10,41          | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL             | 13,06                 |            |
| FONCAIXA AUTONOMOS 1, FTA           | 4,07    | 38,76     | 1,92  | 0,89        | 3,77         | 13,81                        | 4,84                 | 2,97           | 47.COMERCIO AL POR MENOR, EXCEPTO DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS                               | 21,07                 |            |
| FONCAIXA EMPRESAS 3, FTA            | 4,80    | 40,73     | 4,14  | 2,51        | 3,78         | 10,97                        | 3,76                 | 14,91          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 20,16                 |            |

| FONDO                          | TAA (1) | % DEUDA /<br>VT (2) | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD (7) | POR DEUDOR (8) | TASA DE CONCENTRACIÓN  |            |
|--------------------------------|---------|---------------------|-------------|--------------|------------------------------|----------------------|----------------|----------------|--|------------|
|                                |         |                     |             |              |                              |                      |                |                | GEOGRÁFICA   |            |
|                                |         |                     |             |              |                              |                      |                |                | ÁREA   | PORCENTAJE |
| FONCAIXA FTGENCAT 3, FTA       | 4,10    | 33,00               | 1,89        | 4,14         | 14,85                        | 12,48                | 9,74           | 3,32           | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 37,58      |
| FONCAIXA FTGENCAT 4, FTA       | 3,54    | 44,96               | 2,17        | 2,24         | 21,05                        | 14,01                | 8,85           | 4,17           | 47.COMERCIO AL POR MENOR, EXCEPTO DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS                               | 17,85      |
| FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA       | 2,79    | 41,98               | 3,00        | 4,36         | 10,33                        | 15,25                | 6,87           | 5,41           | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 18,94      |
| FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA       | 2,34    | 43,17               | 2,55        | 4,05         | 13,49                        | 15,83                | 6,27           | 3,28           | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 22,13      |
| FONCAIXA LEASINGS 1, FTA       | 2,85    | 50,63               | 1,87        | 1,40         | 0,47                         | 7,66                 | 4,92           | 17,89          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 24,62      |
| FONCAIXA PYMES 3, FTA          | 0,85    | 22,04               | 0,15        | 0,01         | 0,00                         | 5,36                 | 2,94           | 2,66           | 47.COMERCIO AL POR MENOR, EXCEPTO DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS                               | 10,31      |
| FTA FTPYME SANTANDER 1         | 2,42    | 19,46               | 2,39        | 0,01         | 0,00                         | 7,00                 | 9,00           | 3,85           | 46.COMERCIO AL POR MAYOR E INTERMEDIARIOS DEL COMERCIO, EXCEPTO DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS | 1,01       |
| FTA FTPYME SANTANDER 2         | 2,12    | 27,83               | 3,02        | 0,00         | 0,00                         | 11,00                | 8,00           | 4,06           | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 0,62       |
| FTA PYMES SANTANDER 3          | 4,93    | 0,00                | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 4,00                 | 3,00           | 5,23           | 46.COMERCIO AL POR MAYOR E INTERMEDIARIOS DEL COMERCIO, EXCEPTO DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS | 7,63       |
| FTA PYMES SANTANDER 4          | 0,39    | 70,45               | 0,38        | 0,00         | 0,00                         | 3,00                 | 0,90           | 2,92           | 46.COMERCIO AL POR MAYOR E INTERMEDIARIOS DEL COMERCIO, EXCEPTO DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS | 13,95      |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 10, FTA | 3,45    | 79,86               | 10,47       | 1,93         | 100,00                       | 2,00                 | 2,00           | 16,08          | 45.VENTA Y REPARACIÓN DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS   | 12,64      |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 2       | 1,75    | 60,02               | 5,48        | 2,22         | 9,48                         | 5,00                 | 6,00           | 34,99          | 55.SERVICIOS DE ALOJAMIENTO  | 0,41       |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 4       | 4,34    | 68,16               | 10,26       | 5,48         | 0,00                         | 9,00                 | 5,00           | 1,27           | -  | 0,29       |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 8, FTA  | 4,69    | 44,08               | 22,36       | 0,00         | 0,00                         | 4,00                 | 1,00           | 12,49          | 41.CONSTRUCCIÓN DE EDIFICIOS   | 30,06      |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 9, FTA  | 8,10    | 78,08               | 12,44       | 2,77         | 100,00                       | 3,00                 | 2,00           | 19,29          | 41.CONSTRUCCIÓN DE EDIFICIOS   | 13,21      |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 1      | 2,32    | 49,30               | 6,79        | 0,52         | 6,84                         | 10,00                | 7,00           | 20,69          | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL             | 24,23      |

| FONDO                              | TAA (1) | % DEUDA /<br>VT (2) | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD (7) | POR DEUDOR (8) | TASA DE CONCENTRACIÓN  |            |
|------------------------------------|---------|---------------------|-------------|--------------|------------------------------|----------------------|----------------|----------------|--|------------|
|                                    |         |                     |             |              |                              |                      |                |                | GEOGRÁFICA   |            |
|                                    |         |                     |             |              |                              |                      |                |                | ÁREA   | PORCENTAJE |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 3          | 2,17    | 57,79               | 8,92        | 1,10         | 5,93                         | 11,00                | 5,00           | 18,10          | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL | 13,38      |
| FTPYME BANCAJA 2 FTA               | 7,03    | 31,14               | 18,09       | 0,21         | 0,00                         | 6,78                 | 10,92          | 16,87          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 30,07      |
| FTPYME BANCAJA 3 FTA               | 8,11    | 34,85               | 25,35       | 2,31         | 20,28                        | 7,49                 | 9,81           | 26,32          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 21,03      |
| FTPYME BANCAJA 6 FTA               | 7,03    | 43,05               | 29,51       | 2,55         | 9,38                         | 10,06                | 6,66           | 12,25          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 14,99      |
| FTPYME TDA 6, FTA                  | 7,24    | 35,73               | 3,61        | 0,00         | 0,00                         | 9,87                 | 8,16           | 22,80          | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL | 27,21      |
| FTPYME TDA 7, FTA                  | 12,36   | 42,54               | 17,22       | 0,00         | 0,00                         | 10,86                | 6,26           | 15,82          | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL | 31,51      |
| FTPYME TDA CAM 2, FTA              | 3,53    | 23,92               | 20,62       | 0,00         | 0,00                         | 5,89                 | 10,30          | 14,17          | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL | 21,28      |
| FTPYME TDA CAM 4, FTA              | 3,23    | 44,90               | 18,20       | 0,00         | 0,00                         | 11,99                | 8,24           | 4,96           | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL | 16,06      |
| FTPYME TDA CAM 7, FTA              | 3,44    | 52,86               | 15,96       | 0,00         | 0,00                         | 17,73                | 6,12           | 7,14           | 33.REPARACIÓN E INSTALACIÓN DE MAQUINARIA Y EQUIPO                                       | 11,11      |
| FTPYME TDA CAM 9, FTA              | 2,79    | 45,20               | 13,17       | 0,00         | 0,00                         | 11,83                | 5,08           | 6,34           | 12.INDUSTRIA DEL TABACO  | 9,25       |
| GAT FTGENCAT 2005, FTA             | 5,58    | 32,46               | 4,00        | 14,80        | 18,75                        | 7,00                 | 8,92           | 18,49          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 6,17       |
| GAT FTGENCAT 2006, FTA             | 4,55    | 31,21               | 11,36       | 16,56        | 10,32                        | 7,73                 | 7,99           | 19,00          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 12,02      |
| GAT FTGENCAT 2007, FTA             | 3,57    | 41,14               | 9,98        | 20,16        | 9,26                         | 11,22                | 6,53           | 11,98          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 8,29       |
| GAT FTGENCAT 2008, FTA             | 4,76    | 42,96               | 12,25       | 12,19        | 4,12                         | 12,06                | 6,17           | 11,91          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 7,34       |
| GAT FTGENCAT 2009, FTA             | 2,54    | 38,62               | 12,48       | 5,21         | 11,88                        | 8,57                 | 6,44           | 9,52           | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 9,94       |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 1, FTA  | 5,90    | 44,03               | 17,68       | 2,87         | 0,00                         | 9,63                 | 7,24           | 17,15          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 24,77      |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 2, FTA  | 3,60    | 51,65               | 8,61        | 1,46         | 0,00                         | 15,01                | 6,61           | 16,02          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 31,65      |
| GC FTGENCAT CAIXA TARRAGONA 1, FTA | 1,71    | 42,75               | 8,30        | 7,32         | 8,94                         | 13,64                | 7,33           | 17,92          | 41.CONSTRUCCIÓN DE EDIFICIOS   | 18,10      |

| FONDO                             | TAA (1) | % DEUDA /<br>VT (2) | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD (7) | POR DEUDOR (8) | TASA DE CONCENTRACIÓN  |            |
|-----------------------------------|---------|---------------------|-------------|--------------|------------------------------|----------------------|----------------|----------------|--|------------|
|                                   |         |                     |             |              |                              |                      |                |                | GEOGRÁFICA   |            |
|                                   |         |                     |             |              |                              |                      |                |                | ÁREA   | PORCENTAJE |
| GC FTGENCAT SABADELL 1, FTA       | 10,99   | 28,64               | 2,05        | 10,23        | 19,93                        | 4,46                 | 8,00           | 18,80          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 30,89      |
| GC FTPYME PASTOR 4, FTA           | 6,06    | 57,28               | 9,77        | 24,26        | 0,55                         | 9,10                 | 7,49           | 19,73          | 47.COMERCIO AL POR MENOR, EXCEPTO DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS                   | 22,94      |
| GC FTPYME SABADELL 4, FTA         | 11,87   | 31,22               | 6,38        | 8,88         | 12,50                        | 7,92                 | 9,13           | 10,01          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 44,22      |
| GC FTPYME SABADELL 5, FTA         | 11,87   | 31,78               | 2,70        | 7,67         | 20,83                        | 7,47                 | 8,04           | 13,25          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 36,38      |
| GC FTPYME SABADELL 6, FTA         | 8,26    | 34,96               | 5,19        | 8,24         | 15,89                        | 8,26                 | 7,12           | 9,38           | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 36,84      |
| GC FTPYME SABADELL 8, FTA         | 8,39    | 36,53               | 4,85        | 3,35         | 8,27                         | 7,57                 | 4,12           | 11,18          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 30,08      |
| GC FTPYME UNNIM 1, FTA            | 7,26    | 44,19               | 6,47        | 0,44         | 0,00                         | 9,59                 | 3,35           | 7,98           | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 13,23      |
| GC SABADELL EMPRESAS 2, FTA       | 4,31    | 41,51               | 4,65        | 9,09         | 11,49                        | 6,80                 | 6,56           | 19,11          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 32,02      |
| GC SABADELL EMPRESAS 4, FTA       | 4,00    | 43,73               | 3,07        | 5,08         | 14,51                        | 6,50                 | 5,72           | 24,48          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 30,55      |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 1, FTA    | 4,77    | 30,28               | 10,11       | 0,00         | 0,00                         | 7,18                 | 9,74           | 9,99           | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL | 6,74       |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 2, FTA    | 3,96    | 41,37               | 11,67       | 0,00         | 0,00                         | 10,36                | 5,94           | 10,61          | 45.VENTA Y REPARACIÓN DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS                               | 8,57       |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 3, FTA    | 11,23   | 66,96               | 2,28        | 0,00         | 0,00                         | 5,82                 | 2,68           | 17,83          | 41.CONSTRUCCIÓN DE EDIFICIOS   | 13,82      |
| IM BES EMPRESAS 1, FTA            | 10,15   | 64,81               | 6,27        | 1,25         | 39,54                        | 9,29                 | 4,72           | 25,11          | 41.CONSTRUCCIÓN DE EDIFICIOS   | 17,87      |
| IM CAJA LABORAL EMPRESAS 1, FTA   | 4,25    | 50,36               | 3,18        | 0,00         | 0,00                         | 10,17                | 5,69           | 8,72           | 82.ACTIVIDADES ADMINISTRATIVAS DE OFICINA Y OTRAS ACTIVIDADES AUXILIARES A LAS EMPRESAS  | 6,59       |
| IM CAJAMAR EMPRESAS 2 FTPYME, FTA | 5,13    | 41,57               | 11,66       | 0,00         | 0,00                         | 9,74                 | 5,58           | 7,46           | 45.VENTA Y REPARACIÓN DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS                               | 6,17       |
| IM CAJAMAR EMPRESAS 4, FTA        | 4,79    | 41,96               | 2,13        | 0,00         | 0,00                         | 7,27                 | 4,11           | 4,53           | 01.AGRICULTURA, GANADERÍA, CAZA Y SERVICIOS RELACIONADOS CON LAS MISMAS                  | 20,82      |
| IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA       | 6,38    | 0,00                | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 6,46                 | 7,18           | 14,87          | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL | 12,35      |

| FONDO                                  | TAA (1) | % DEUDA /<br>VT (2) | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD (7) | POR DEUDOR (8) | TASA DE CONCENTRACIÓN  |            |
|--|---------|---------------------|-------------|--------------|------------------------------|----------------------|----------------|----------------|--|------------|
|  |         |                     |             |              |                              |                      |                |                | GEOGRÁFICA   |            |
|  |         |                     |             |              |                              |                      |                |                | ÁREA   | PORCENTAJE |
| IM FTGENCAT SABADELL 3, FTA            | 4,59    | 43,40               | 14,57       | 0,00         | 0,00                         | 9,92                 | 6,44           | 13,58          | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL | 30,95      |
| IM FTGENCAT SABADELL 4, FTA            | 9,98    | 44,85               | 9,54        | 0,00         | 0,00                         | 9,13                 | 5,68           | 14,87          | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL | 39,16      |
| IM FTPYME SABADELL 3, FTA              | 10,09   | 30,65               | 3,66        | 0,00         | 0,00                         | 7,70                 | 9,95           | 20,14          | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL | 12,39      |
| IM FTPYME SABADELL 7, FTA              | 9,90    | 41,19               | 6,84        | 0,00         | 0,00                         | 9,11                 | 5,99           | 15,44          | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL | 13,85      |
| IM FTPYME SABADELL 9, FTA              | 8,72    | 43,11               | 2,94        | 0,00         | 0,00                         | 7,84                 | 3,01           | 7,82           | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 18,97      |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, FTA | 3,60    | 32,64               | 14,59       | 0,00         | 0,00                         | 7,64                 | 8,46           | 15,92          | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL | 13,29      |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 3, FTA | 5,28    | 72,40               | 10,66       | 0,00         | 0,00                         | 10,24                | 4,99           | 16,71          | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL | 6,86       |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 4, FTA | 14,75   | 0,00                | 6,94        | 0,00         | 0,00                         | 4,14                 | 3,08           | 12,78          | 45.VENTA Y REPARACIÓN DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS                               | 4,15       |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I FTA    | 5,75    | 38,15               | 11,92       | 0,00         | 0,00                         | 9,97                 | 7,95           | 6,14           | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL | 5,97       |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME II, FTA  | 5,50    | 38,78               | 16,55       | 0,00         | 0,00                         | 7,76                 | 7,11           | 19,69          | 45.VENTA Y REPARACIÓN DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS                               | 4,73       |
| IM GRUPO BANCO POPULAR LEASING 2, FTA  | 8,31    | 0,00                | 4,29        | 0,00         | 0,00                         | 4,99                 | 3,91           | 6,86           | 60.ACTIVIDADES DE PROGRAMACIÓN Y EMISIÓN DE RADIO Y TELEVISIÓN                           | 14,29      |
| IM SABADELL EMPRESAS 1, FTA            | 8,25    | 36,13               | 13,34       | 0,00         | 0,00                         | 8,71                 | 6,67           | 14,72          | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL | 23,25      |

| FONDO                                | TAA (1) | % DEUDA /<br>VT (2) | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD (7) | POR DEUDOR (8) | TASA DE CONCENTRACIÓN  |            |
|--------------------------------------|---------|---------------------|-------------|--------------|------------------------------|----------------------|----------------|----------------|--|------------|
|                                      |         |                     |             |              |                              |                      |                |                | GEOGRÁFICA   |            |
|                                      |         |                     |             |              |                              |                      |                |                | ÁREA   | PORCENTAJE |
| IM SABADELL EMPRESAS 3, FTA          | 16,33   | 39,37               | 5,59        | 0,00         | 0,00                         | 7,31                 | 5,87           | 43,70          | 55.SERVICIOS DE ALOJAMIENTO  | 11,07      |
| IM SABADELL EMPRESAS 5, FTA          | 11,61   | 54,91               | 18,01       | 0,00         | 0,00                         | 7,46                 | 4,53           | 14,83          | 41.CONSTRUCCIÓN DE EDIFICIOS   | 3,60       |
| IM TERRASSA 1 FTGENCAT FTA           | 5,87    | 38,97               | 10,32       | 0,00         | 0,00                         | 8,94                 | 9,21           | 20,35          | 70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL | 22,07      |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS III, FTA | 0,07    | 0,00                | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 7,26                 | 8,02           | 98,44          | 65.SEGUROS, REASEGUROS Y FONDOS DE PENSIONES, EXCEPTO SEGURIDAD SOCIAL OBLIGATORIA       | 42,73      |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS IV, FTA  | 8,78    | 0,00                | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 12,61                | 4,96           | 52,87          | 35.SUMINISTRO DE ENERGÍA ELÉCTRICA, GAS, VAPOR Y AIRE ACONDICIONADO                      | 74,11      |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS V, FTA   | 5,66    | 0,00                | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 12,35                | 2,25           | 47,21          | 35.SUMINISTRO DE ENERGÍA ELÉCTRICA, GAS, VAPOR Y AIRE ACONDICIONADO                      | 30,34      |
| MADRID FTPYME I, FTA                 | 4,55    | 55,53               | 3,38        | 0,05         | 0,00                         | 7,01                 | 4,36           | 9,80           | 47.COMERCIO AL POR MENOR, EXCEPTO DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS                   | 11,28      |
| MADRID FTPYME II, FTA                | 5,73    | 79,71               | 1,76        | 0,00         | 0,00                         | 5,32                 | 3,23           | 9,69           | 35.SUMINISTRO DE ENERGÍA ELÉCTRICA, GAS, VAPOR Y AIRE ACONDICIONADO                      | 12,81      |
| PYME BANCAJA 5, FTA                  | 10,71   | 42,33               | 27,67       | 1,24         | 0,00                         | 9,58                 | 7,42           | 17,76          | 41.CONSTRUCCIÓN DE EDIFICIOS   | 22,88      |
| PYME BANCAJA 7, FTA                  | 7,98    | 48,66               | 25,31       | 1,88         | 2,32                         | 11,79                | 6,27           | 5,96           | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 29,21      |
| PYME VALENCIA 1, FTA                 | 4,73    | 43,81               | 24,93       | 1,45         | 0,00                         | 8,17                 | 7,47           | 21,00          | 41.CONSTRUCCIÓN DE EDIFICIOS   | 24,78      |
| PYME VALENCIA 2, FTA                 | 4,37    | 43,38               | 16,66       | 0,08         | 0,00                         | 9,75                 | 6,99           | 11,53          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 19,23      |
| PYMECAT 2 FTPYME, FTA                | 9,10    | 39,19               | 10,86       | 15,29        | 13,19                        | 8,68                 | 6,30           | 13,96          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 5,96       |
| PYMECAT 3 FTPYME, FTA                | 9,43    | 40,57               | 6,59        | 1,76         | 0,00                         | 7,56                 | 4,13           | 12,45          | 68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS   | 7,76       |
| PYMES BANESTO 2, FTA                 | 3,42    | 29,21               | 12,77       | 0,00         | 0,00                         | 4,00                 | 7,00           | 2,73           | 55.SERVICIOS DE ALOJAMIENTO  | 0,30       |
| RURALPYME 1 FTPYME FTA               | 5,12    | 30,68               | 7,22        | 0,26         | 0,00                         | 6,65                 | 9,78           | 20,41          | 01.AGRICULTURA, GANADERÍA, CAZA Y SERVICIOS RELACIONADOS CON LAS MISMAS                  | 11,29      |

| FONDO                         | TAA (1)     | % DEUDA /<br>VT (2) | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD (7) | POR DEUDOR (8) | TASA DE CONCENTRACIÓN   |              |
|-------------------------------|-------------|---------------------|-------------|--------------|------------------------------|----------------------|----------------|----------------|---|--------------|
|                               |             |                     |             |              |                              |                      |                |                | GEOGRÁFICA  |              |
|                               |             |                     |             |              |                              |                      |                |                | ÁREA  | PORCENTAJE   |
| RURALPYME 2 FTPYME FTA        | 9,77        | 33,16               | 14,41       | 0,17         | 0,00                         | 7,19                 | 7,88           | 12,54          | 01.AGRICULTURA, GANADERÍA,<br>CAZA Y SERVICIOS<br>RELACIONADOS CON LAS MISMAS                                 | 17,13        |
| TDA CORPORATIVOS I, FTA       | 3,68        | 53,25               | 2,65        | 0,00         | 0,00                         | 1,89                 | 4,80           | 97,90          | 45.VENTA Y REPARACIÓN DE<br>VEHÍCULOS DE MOTOR Y<br>MOTOCICLETAS  | 36,03        |
| TDA EMPRESAS 1, FTA           | 5,00        | 0,00                | 24,11       | 0,00         | 0,00                         | 4,26                 | 4,66           | 21,05          | 25.FABRICACIÓN DE PRODUCTOS<br>METÁLICOS, EXCEPTO<br>MAQUINARIA Y EQUIPO                                      | 14,97        |
| TDA EMPRESAS 2, FTA           | 6,46        | 26,06               | 17,98       | 0,01         | 0,00                         | 3,27                 | 2,87           | 20,71          | 46.COMERCIO AL POR MAYOR E<br>INTERMEDIARIOS DEL COMERCIO,<br>EXCEPTO DE VEHÍCULOS DE<br>MOTOR Y MOTOCICLETAS | 8,43         |
| TDA FTPYME PASTOR 9, FTA      | 7,25        | 49,53               | 7,29        | 0,01         | 0,00                         | 10,56                | 3,48           | 11,13          | 47.COMERCIO AL POR MENOR,<br>EXCEPTO DE VEHÍCULOS DE<br>MOTOR Y MOTOCICLETAS                                  | 14,90        |
| TDA LICO LEASING III, FTA     | 1,34        | 54,57               | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 3,40                 | 2,11           | 4,90           | 49.TRANSPORTE TERRESTRE Y POR<br>TUBERÍA  | 42,15        |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA | 10,93       | 29,66               | 0,66        | 0,00         | 0,00                         | 8,65                 | 8,03           | 41,37          | 55.SERVICIOS DE ALOJAMIENTO   | 44,13        |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA | 10,93       | 42,08               | 2,92        | 0,00         | 0,00                         | 13,94                | 6,52           | 13,65          | 41.CONSTRUCCIÓN DE EDIFICIOS  | 11,04        |
| UNICAJA AYT EMPRESAS I, FTA   | 4,15        | 51,17               | 4,32        | 0,00         | 0,00                         | 12,61                | 6,65           | 5,53           | 52.ALMACENAMIENTO Y<br>ACTIVIDADES ANEXAS AL<br>TRANSPORTE  | 16,11        |
| <b>Medias</b>                 | <b>5,59</b> | <b>40,81</b>        | <b>7,87</b> | <b>1,08</b>  | <b>8,74</b>                  | <b>7,53</b>          | <b>4,53</b>    | <b>15,52</b>   |   | <b>17,33</b> |

**Información sobre los encabezados**

(1) Tasa de amortización anticipada

(2) Porcentaje que representa la deuda total sobre el valor de tasación de la garantía

(3) Tasa de dudosos: cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos y el principal pendiente del total activos

(4) Tasa de fallidos: cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en balance más el principal de los activos clasificados como fallidos

(5) Tasa de recuperación de fallidos: cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de los fallidos al cierre del mismo periodo del año anterior.

(6) Vida residual media ponderada valorada en años

(7) Antigüedad media ponderada valorada en años

(8) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración



| FONDO                        | TAA (1)     | % DEUDA /<br>VT (2) | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA RESIDUAL<br>(6) | ANTIGÜEDAD (7) | TASA DE CONCENTRACIÓN |            |              |
|------------------------------|-------------|---------------------|-------------|--------------|------------------------------|----------------------|----------------|-----------------------|------------|--------------|
|                              |             |                     |             |              |                              |                      |                | POR DEUDOR (8)        | GEOGRÁFICA |              |
|                              |             |                     |             |              |                              |                      |                |                       | ÁREA       | PORCENTAJE   |
| AYT DEUDA SUBORDINADA I, FTA | 0,00        | 0,00                | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 3,90                 | 6,15           | 100,00                | ANDALUCÍA  | 40,00        |
| <b>Medias</b>                | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>         | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>  | <b>0,00</b>                  | <b>3,90</b>          | <b>6,15</b>    | <b>100,00</b>         |            | <b>40,00</b> |

**Información sobre los encabezados**

(1) Tasa de amortización anticipada

(2) Porcentaje que representa la deuda total sobre el valor de tasación de la garantía

(3) Tasa de dudosos: cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos y el principal pendiente del total activos

(4) Tasa de fallidos: cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en balance más el principal de los activos clasificados como fallidos

(5) Tasa de recuperación de fallidos: cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de los fallidos al cierre del mismo periodo del año anterior.

(6) Vida residual media ponderada valorada en años

(7) Antigüedad media ponderada valorada en años

(8) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

| FONDO                   | TAA (1)     | % DEUDA /   |             | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA RESIDUAL<br>(6) | ANTIGÜEDAD (7) | TASA DE CONCENTRACIÓN |            |              |
|-------------------------|-------------|-------------|-------------|--------------|------------------------------|----------------------|----------------|-----------------------|------------|--------------|
|                         |             | VT (2)      | DUDOSOS (3) |              |                              |                      |                | POR DEUDOR<br>(8)     | GEOGRÁFICA |              |
|                         |             |             |             |              |                              |                      |                |                       | ÁREA       | PORCENTAJE   |
| BCL MUNICIPIOS I FTA    | 1,78        | 0,00        | 6,49        | 0,00         | 0,00                         | 6,23                 | 11,61          | 33,28                 | CATALUÑA   | 28,32        |
| FTA SANTANDER PUBLICO 1 | 0,67        | 6,84        | 1,62        | 0,00         | 0,00                         | 5,00                 | 8,00           | 34,83                 | ANDALUCÍA  | 98,27        |
| <b>Medias</b>           | <b>0,95</b> | <b>5,12</b> | <b>2,84</b> | <b>0,00</b>  | <b>0,00</b>                  | <b>5,31</b>          | <b>8,91</b>    | <b>34,44</b>          |            | <b>80,43</b> |

**Información sobre los encabezados**

(1) Tasa de amortización anticipada

(2) Porcentaje que representa la deuda total sobre el valor de tasación de la garantía

(3) Tasa de dudosos: cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos y el principal pendiente del total activos

(4) Tasa de fallidos: cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en balance más el principal de los activos clasificados como fallidos

(5) Tasa de recuperación de fallidos: cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de los fallidos al cierre del mismo periodo del año anterior.

(6) Vida residual media ponderada valorada en años

(7) Antigüedad media ponderada valorada en años

(8) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

| FONDO                                    | TAA (1) | % DEUDA / |       | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD (7) | POR DEUDOR (8) | TASA DE CONCENTRACIÓN |            |
|--|---------|-----------|-------|-------------|--------------|------------------------------|----------------------|----------------|----------------|-----------------------|------------|
|  |         |           |       |             |              |                              |                      |                |                | GEOGRÁFICA            |            |
|  |         |           |       |             |              |                              |                      |                |                | ÁREA                  | PORCENTAJE |
| AUTO ABS 2012-3, FTA                     | 0,00    | 0,00      | 0,00  | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 3,38                 | 1,99           | 0,05           | ANDALUCÍA             | 22,52      |
| AYT PRESTAMOS CONSUMO III, FTA           | 11,78   | 0,00      | 26,48 | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 1,88                 | 6,88           | 1,26           | ANDALUCÍA             | 63,56      |
| AYT SA NOSTRA FINANCIACION I, FTA        | 16,84   | 0,00      | 9,53  | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 1,87                 | 4,61           | 1,90           | BALEARES              | 98,52      |
| AYT UNICAJA FINANCIACION I, FTA          | 9,86    | 0,00      | 15,94 | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 2,02                 | 5,59           | 0,27           | ANDALUCÍA             | 93,60      |
| BBVA AUTOS 1 FTA                         | 9,79    | 0,00      | 70,22 | 0,04        | 0,00         | 0,00                         | 0,80                 | 8,01           | 1,20           | ANDALUCÍA             | 20,34      |
| BBVA AUTOS 2 FTA                         | 7,56    | 0,00      | 32,65 | 0,05        | 0,00         | 0,00                         | 2,76                 | 6,92           | 0,34           | ANDALUCÍA             | 24,93      |
| BBVA CONSUMO 1, FTA                      | 9,04    | 0,00      | 37,08 | 0,04        | 0,00         | 0,00                         | 3,16                 | 6,37           | 0,30           | ANDALUCÍA             | 24,16      |
| BBVA CONSUMO 2, FTA                      | 9,41    | 0,00      | 30,48 | 0,03        | 4,47         | 0,00                         | 2,68                 | 6,16           | 0,21           | ANDALUCÍA             | 23,50      |
| BBVA CONSUMO 3 FTA                       | 7,49    | 0,00      | 25,26 | 0,02        | 0,00         | 0,00                         | 3,14                 | 5,45           | 0,23           | CATALUÑA              | 21,94      |
| BBVA CONSUMO 4 FTA                       | 7,54    | 0,00      | 12,53 | 0,01        | 0,00         | 0,00                         | 3,44                 | 4,34           | 0,10           | CATALUÑA              | 24,79      |
| BBVA CONSUMO 5, FTA                      | 5,48    | 0,00      | 6,04  | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 4,14                 | 3,09           | 0,08           | CATALUÑA              | 22,03      |
| BBVA FINANZIA AUTOS 1 FTA                | 4,25    | 0,00      | 35,99 | 0,05        | 0,00         | 0,00                         | 3,03                 | 6,21           | 0,29           | CATALUÑA              | 32,85      |
| CONSUMO BANCAJA 1, FTA                   | 10,68   | 0,00      | 66,38 | 16,08       | 2,09         | 0,00                         | 1,61                 | 5,71           | 0,60           | C.VALENCIANA          | 65,94      |
| DRIVER ESPAÑA ONE, FTA                   | 3,37    | 0,00      | 1,85  | 0,06        | 0,00         | 0,00                         | 2,29                 | 3,15           | 0,14           | ANDALUCÍA             | 25,21      |
| FINANCAT 1, FTA                          | 11,88   | 0,00      | 6,43  | 37,13       | 2,06         | 0,00                         | 3,01                 | 5,90           | 0,47           | CATALUÑA              | 76,92      |
| FINANCIACION BANESTO 1, FTA              | 4,86    | 0,00      | 56,08 | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 1,00                 | 5,00           | 1,24           | ANDALUCÍA             | 20,07      |
| FONCAIXA CONSUMO 1, FTA                  | 6,52    | 20,73     | 1,08  | 0,37        | 8,59         | 0,00                         | 14,18                | 4,91           | 0,31           | CATALUÑA              | 40,07      |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 07-1   | 4,19    | 0,00      | 38,56 | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 1,00                 | 5,00           | 0,20           | ANDALUCÍA             | 26,01      |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2011-1 | 2,98    | 0,00      | 1,10  | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 3,00                 | 2,00           | 0,12           | ANDALUCÍA             | 24,29      |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2012-1 | 0,50    | 0,00      | 0,00  | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 2,00                 | 7,00           | 0,05           | ANDALUCÍA             | 22,39      |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 1             | 4,69    | 0,00      | 2,38  | 1,94        | 3,97         | 0,00                         | 6,00                 | 6,00           | 2,04           | MADRID                | 29,48      |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 5             | 14,55   | 0,00      | 5,67  | 1,14        | 0,00         | 0,00                         | 4,00                 | 1,00           | 4,24           | MADRID                | 21,01      |
| IM CITI TARJETAS 1, FTA                  | 0,00    | 0,00      | 9,42  | 6,00        | 0,00         | 0,00                         | 0,00                 | 6,59           | 0,00           | MADRID                | 20,28      |
| MADRID CONSUMO I, FTA                    | 7,91    | 0,00      | 26,33 | 0,10        | 0,05         | 0,00                         | 2,10                 | 5,36           | 0,53           | MADRID                | 65,46      |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN 09-1, FTA       | 4,96    | 0,00      | 14,19 | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 2,00                 | 3,30           | 0,26           | ANDALUCÍA             | 36,34      |

| FONDO                                     | TAA (1)     | % DEUDA /<br>VT (2) | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA<br>RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD (7) | TASA DE CONCENTRACIÓN |            |              |
|---|-------------|---------------------|-------------|--------------|------------------------------|----------------------|----------------|-----------------------|------------|--------------|
|   |             |                     |             |              |                              |                      |                | POR DEUDOR (8)        | GEOGRÁFICA |              |
|   |             |                     |             |              |                              |                      |                |                       | ÁREA       | PORCENTAJE   |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2010-1, FTA | 4,29        | 0,00                | 2,74        | 0,04         | 0,00                         | 3,00                 | 2,00           | 0,00                  | ANDALUCÍA  | 28,75        |
| TDA PASTOR CONSUMO 1, FTA                 | 4,99        | 0,00                | 42,84       | 0,36         | 0,00                         | 2,00                 | 6,44           | 1,12                  | GALICIA    | 40,60        |
| <b>Medias</b>                             | <b>5,15</b> | <b>5,57</b>         | <b>7,61</b> | <b>1,36</b>  | <b>2,49</b>                  | <b>5,72</b>          | <b>4,39</b>    | <b>0,47</b>           |            | <b>30,37</b> |

**Información sobre los encabezados**

(1) Tasa de amortización anticipada

(2) Porcentaje que representa la deuda total sobre el valor de tasación de la garantía

(3) Tasa de dudosos: cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos y el principal pendiente del total activos

(4) Tasa de fallidos: cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en balance más el principal de los activos clasificados como fallidos

(5) Tasa de recuperación de fallidos: cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de los fallidos al cierre del mismo periodo del año anterior.

(6) Vida residual media ponderada valorada en años

(7) Antigüedad media ponderada valorada en años

(8) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

| FONDO | TAA (1) | % DEUDA /<br>VT (2) | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA RESIDUAL<br>(6) | ANTIGÜEDAD (7) | TASA DE CONCENTRACIÓN |            |            |
|-------|---------|---------------------|-------------|--------------|------------------------------|----------------------|----------------|-----------------------|------------|------------|
|       |         |                     |             |              |                              |                      |                | POR DEUDOR (8)        | GEOGRÁFICA |            |
|       |         |                     |             |              |                              |                      |                |                       | ÁREA       | PORCENTAJE |

**Información sobre los encabezados**

(1) Tasa de amortización anticipada

(3) Tasa de dudosos: cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos y el principal pendiente del total activos

(4) Tasa de fallidos: cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en balance más el principal de los activos clasificados como fallidos

(5) Tasa de recuperación de fallidos: cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de los fallidos al cierre del mismo periodo del año anterior.

(6) Vida residual media ponderada valorada en años

(7) Antigüedad media ponderada valorada en años

(8) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

| FONDO | TAA (1) | % DEUDA /<br>VT (2) | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA RESIDUAL<br>(6) | ANTIGÜEDAD (7) | TASA DE CONCENTRACIÓN |            |            |
|-------|---------|---------------------|-------------|--------------|------------------------------|----------------------|----------------|-----------------------|------------|------------|
|       |         |                     |             |              |                              |                      |                | POR DEUDOR (8)        | GEOGRÁFICA |            |
|       |         |                     |             |              |                              |                      |                |                       | ÁREA       | PORCENTAJE |

**Información sobre los encabezados**

(1) Tasa de amortización anticipada

(3) Tasa de dudosos: cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos y el principal pendiente del total activos

(4) Tasa de fallidos: cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en balance más el principal de los activos clasificados como fallidos

(5) Tasa de recuperación de fallidos: cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de los fallidos al cierre del mismo periodo del año anterior.

(6) Vida residual media ponderada valorada en años

(7) Antigüedad media ponderada valorada en años

(8) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

| FONDO | TAA (1) | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN FALLIDOS (5) | VIDA RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD (7) | CONC. POR DEUDOR (8) |
|-------|---------|-------------|--------------|---------------------------|-------------------|----------------|----------------------|
|-------|---------|-------------|--------------|---------------------------|-------------------|----------------|----------------------|

**Información sobre los encabezados**

(1) Tasa de amortización anticipada

(3) Tasa de dudosos: cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos y el principal pendiente del total activos

(4) Tasa de fallidos: cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en balance más el principal de los activos clasificados como fallidos

(5) Tasa de recuperación de fallidos: cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de los fallidos al cierre del mismo periodo del año anterior.

(6) Vida residual media ponderada valorada en años

(7) Antigüedad media ponderada valorada en años

(8) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

| FONDO (A)  | TAA (1)     | % DEUDA /<br>VT (2) | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN<br>FALLIDOS (5) | VIDA RESIDUAL<br>(6) | ANTIGÜEDAD (7) | TASA DE CONCENTRACIÓN |            |              |
|--|-------------|---------------------|-------------|--------------|------------------------------|----------------------|----------------|-----------------------|------------|--------------|
|  |             |                     |             |              |                              |                      |                | POR DEUDOR (8)        | GEOGRÁFICA |              |
|  |             |                     |             |              |                              |                      |                |                       | ÁREA       | PORCENTAJE   |
| FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA | 0,00        | 0,00                | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 13,66                | 1,18           | 100,00                | MADRID     | 100,00       |
| ICO MEDIACION I AYT, FTA                                     | 5,59        | 0,00                | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 2,26                 | 6,71           | 60,82                 | MADRID     | 100,00       |
| ICO MEDIACION II AYT FTA                                     | 5,88        | 0,00                | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 3,76                 | 3,54           | 69,18                 | MURCIA     | 40,72        |
| IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, FTA                             | 0,00        | 0,00                | 0,00        | 0,00         | 0,00                         | 2,47                 | 8,87           | 100,00                | MADRID     | 100,00       |
| <b>Medias</b>  | <b>2,53</b> | <b>0,00</b>         | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>  | <b>0,00</b>                  | <b>9,28</b>          | <b>2,32</b>    | <b>86,53</b>          |            | <b>75,78</b> |

**Información sobre los encabezados**

(1) Tasa de amortización anticipada

(2) Porcentaje que representa la deuda total sobre el valor de tasación de la garantía

(3) Tasa de dudosos: cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos y el principal pendiente del total activos

(4) Tasa de fallidos: cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en balance más el principal de los activos clasificados como fallidos

(5) Tasa de recuperación de fallidos: cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de los fallidos al cierre del mismo periodo del año anterior.

(6) Vida residual media ponderada valorada en años

(7) Antigüedad media ponderada valorada en años

(8) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración



| FONDO (A)       | TIPO DE<br>ACTIVOS  | TAA (1)     | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN FALLIDOS (5) | VIDA RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD<br>(7) | CONC. POR<br>DEUDOR (8) |
|-----------------|---------------------|-------------|-------------|--------------|---------------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| FTA SANTANDER 2 | CUENTAS A<br>COBRAR | 0,00        | 0,30        | 2,57         | 50,00                     | 0,00              | 0,00              | 46,05                   |
| <b>Medias</b>   |                     | <b>0,00</b> | <b>0,30</b> | <b>2,57</b>  | <b>50,00</b>              | <b>0,00</b>       | <b>0,00</b>       | <b>46,05</b>            |

**Información sobre los encabezados**

(1) Tasa de amortización anticipada

(3) Tasa de dudosos: cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos y el principal pendiente del total activos

(4) Tasa de fallidos: cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en balance más el principal de los activos clasificados como fallidos

(5) Tasa de recuperación de fallidos: cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de los fallidos al cierre del mismo periodo del año anterior.

(6) Vida residual media ponderada valorada en años

(7) Antigüedad media ponderada valorada en años

(8) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

| FONDO                                   | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |           |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |           |                  |           |  | MEJORAS    |          |                         |
|---|----------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|-------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|------------|----------|-------------------------|
|   | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1) | % FR (2) | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|   | PRINCIPAL                        | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  |            |          |                         |
| <b>BONOS</b>                            |                                  |           |                  |           |  |                               |           |                  |           |  |            |          |                         |
| AUTO ABS 2012-3, FTA                    | 668.000                          | 1.963     | 0                | 0         | 0  | 132.000                       | 412       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,03     | 3,61                    |
| AYT ANDALUCIA FTEMPRESA CAJAMAR, FTA    | 79.573                           | 29        | 0                | 0         | 0  | 76.000                        | 54        | 0                | 0         | 0  | 51,15      | 17,02    | 0,00                    |
| AYT CAIXA GALICIA EMPRESAS I, FTA       | 137.373                          | 122       | 0                | 0         | -9.326   | 122.500                       | 779       | 0                | 5.534     | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| AYT CAIXA SABADELL HIPOTECARIO I, FTA   | 192.438                          | 151       | 0                | 0         | -2.954   | 51.600                        | 101       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,95     | 0,00                    |
| AYT CAIXANOVA FTPYME I, FTA             | 47                               | 0         | 0                | 0         | 0  | 56.049                        | 281       | 0                | 0         | 0  | 0,08       | 26,39    | 0,00                    |
| AYT CAIXANOVA HIPOTECARIO I, FTA        | 153.457                          | 138       | 0                | 0         | 0  | 25.500                        | 137       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,91     | 0,00                    |
| AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA              | 729.080                          | 358       | 0                | 0         | 0  | 135.000                       | 126       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 8,37     | 0,00                    |
| AYT CAJA MURCIA HIPOTECARIO I, FTA      | 114.723                          | 85        | 0                | 0         | 0  | 9.667                         | 13        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,44     | 0,00                    |
| AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA      | 160.524                          | 35        | 0                | 0         | 0  | 37.000                        | 17        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,66     | 0,00                    |
| AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FTA      | 126.914                          | 107       | 0                | 0         | 0  | 10.372                        | 15        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,26     | 0,00                    |
| AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA            | 36.720.000                       | 462.845   | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| AYT CEDULAS CAJAS IV, FTA               | 3.800.000                        | 122.433   | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,76     | 0,00                    |
| AYT CEDULAS CAJAS IX, FTA               | 5.000.000                        | 144.617   | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| AYT CEDULAS CAJAS V, FTA                | 3.100.000                        | 11.104    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| AYT CEDULAS CAJAS VI, FTA               | 3.300.000                        | 97.283    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,10     | 0,00                    |
| AYT CEDULAS CAJAS VIII, FTA             | 4.100.000                        | 20.102    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| AYT CEDULAS CAJAS X, FTA                | 3.900.000                        | 38.041    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FTA    | 238.235                          | 472       | 0                | 0         | 0  | 177.400                       | 708       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA | 4.080.228                        | 5.152     | 0                | 0         | -4.527   | 601.700                       | 1.380     | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| AYT DEUDA SUBORDINADA I, FTA            | 214.500                          | 84        | 0                | 0         | 0  | 83.500                        | 55        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| AYT FONDO EOLICO, FTA                   | 15.300                           | 66        | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| AYT FTPYME II, FTA                      | 8.337                            | 8         | 0                | 0         | 0  | 67.227                        | 107       | 0                | 0         | 0  | 43,97      | 17,16    | 14,67                   |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO II, FTH          | 221.383                          | 42        | 0                | 0         | 0  | 14.131                        | 5         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,44     | 0,00                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO III, FTH         | 249.608                          | 249       | 0                | 0         | 0  | 15.933                        | 30        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,50     | 0,00                    |

| FONDO                               | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |           |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |           |                  |           |  | MEJORAS    |          |                         |
|-------------------------------------|----------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|-------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|------------|----------|-------------------------|
|                                     | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1) | % FR (2) | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|                                     | PRINCIPAL                        | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  |            |          |                         |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, FTH      | 279.154                          | 132       | 0                | 0         | 0  | 17.818                        | 16        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,47     | 0,00                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH      | 558.990                          | 437       | 0                | 0         | 0  | 32.500                        | 83        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,78     | 0,00                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH      | 296.713                          | 232       | 0                | 0         | 0  | 19.950                        | 45        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,90     | 0,00                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH     | 652.911                          | 88        | 0                | 0         | 0  | 43.550                        | 11        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,44     | 0,00                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH    | 984.947                          | 427       | 0                | 0         | 0  | 62.958                        | 89        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,68     | 0,00                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH       | 628.844                          | 87        | 0                | 0         | 0  | 42.000                        | 23        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,30     | 0,00                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH      | 756.535                          | 387       | 0                | 0         | 0  | 46.800                        | 71        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 4,19     | 0,00                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH     | 542.027                          | 109       | 0                | 0         | 0  | 22.000                        | 7         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 4,55     | 0,00                    |
| AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA       | 3.277.377                        | 619       | 0                | 0         | 0  | 250.000                       | 70        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 7,98     | 0,00                    |
| AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA        | 949.491                          | 2.217     | 0                | 0         | 0  | 234.000                       | 753       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,61     | 0,00                    |
| AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA         | 1.053.632                        | 2.460     | 0                | 0         | 0  | 280.000                       | 901       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 6,43     | 0,00                    |
| AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA          | 390.125                          | 428       | 0                | 0         | 0  | 85.500                        | 150       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,16     | 0,00                    |
| AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA         | 506.980                          | 539       | 0                | 0         | 0  | 82.000                        | 137       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,72     | 0,00                    |
| AYT HIPOTECARIO III, FTH            | 66.522                           | 12        | 0                | 0         | 0  | 13.200                        | 4         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 4,88     | 0,00                    |
| AYT HIPOTECARIO IV, FTH             | 56.647                           | 13        | 0                | 0         | 0  | 14.000                        | 6         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,02     | 0,00                    |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FTA       | 126.977                          | 16        | 0                | 0         | 0  | 29.400                        | 11        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA      | 90.978                           | 9         | 0                | 0         | -2.411   | 27.800                        | 7         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, FTA       | 132.069                          | 95        | 0                | 0         | 0  | 17.483                        | 29        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,59     | 0,00                    |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA        | 315.567                          | 66        | 0                | 0         | 0  | 25.600                        | 11        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,65     | 0,00                    |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO, FTA          | 51.234                           | 9         | 0                | 0         | 0  | 31.800                        | 12        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 21,65    | 0,00                    |
| AYT ICO FTVPO CAIXA GALICIA I, FTA  | 108.495                          | 106       | 0                | 0         | 0  | 17.000                        | 31        | 0                | 0         | 0  | 86,45      | 10,21    | 11,62                   |
| AYT ICO-FTVPO CAJA MURCIA, FTA      | 92.929                           | 91        | 0                | 0         | 0  | 18.000                        | 34        | 0                | 0         | 0  | 83,77      | 8,82     | 10,96                   |
| AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA | 104.533                          | 154       | 0                | 0         | 0  | 14.600                        | 32        | 0                | 0         | 0  | 87,74      | 6,94     | 12,09                   |
| AYT ICO-FTVPO I, FTA                | 209.109                          | 229       | 0                | 0         | 0  | 23.900                        | 52        | 0                | 0         | 0  | 89,74      | 5,00     | 0,00                    |
| AYT ICO-FTVPO III, FTA              | 165.400                          | 198       | 0                | 0         | 0  | 23.000                        | 53        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA        | 385.525                          | 262       | 0                | 0         | 0  | 49.900                        | 63        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,17     | 0,00                    |

| FONDO                                   | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |           |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |           |                  |           |  | MEJORAS    |          |                         |
|---|----------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|-------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|------------|----------|-------------------------|
|   | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1) | % FR (2) | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|   | PRINCIPAL                        | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  |            |          |                         |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA           | 701.145                          | 518       | 0                | 0         | 0  | 82.200                        | 99        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,71     | 0,00                    |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO IV, FTA           | 599.440                          | 2.733     | 0                | 0         | 0  | 1.040.000                     | 5.409     | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 6,28     | 0,00                    |
| AYT PRESTAMOS CONSUMO III, FTA          | 22.039                           | 70        | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 42,84    | 0,00                    |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS II, FTA   | 49.580                           | 14        | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 60,39    | 456,82                  |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS III, FTA  | 54.222                           | 9         | 0                | 0         | 0  | 17.659                        | 6         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 7,43     | 40,51                   |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS IV, FTA   | 51.163                           | 48        | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 102,11   | 363,26                  |
| AYT SA NOSTRA FINANCIACION I, FTA       | 3.383                            | 2         | 0                | 0         | 0  | 10.600                        | 12        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 61,44    | 0,00                    |
| AYT UNICAJA FINANCIACION I, FTA         | 15.668                           | 18        | 0                | 0         | 0  | 124.700                       | 334       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 37,81    | 0,00                    |
| AYT VPO II, FTA                         | 99.494                           | 116       | 0                | 0         | 0  | 15.350                        | 34        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 10,23    | 0,00                    |
| AYT.1, FTH                              | 29.287                           | 6         | 0                | 0         | 0  | 1.464                         | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 15,67    | 0,00                    |
| AYT.11, FTH                             | 73.705                           | 105       | 0                | 0         | 0  | 12.100                        | 26        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,02     | 0,00                    |
| AYT.2, FTH                              | 14.208                           | 3         | 0                | 0         | 0  | 1.422                         | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 15,08    | 0,00                    |
| AYT.7, PROMOCIONES INMOBILIARIAS I, FTA | 25.077                           | 6         | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 35,61    | 0,00                    |
| BANCAJA - BVA VPO 1, FTA                | 284.842                          | 279       | 0                | 0         | 0  | 18.600                        | 52        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 7,68     | 0,00                    |
| BANCAJA 10, FTA                         | 924.332                          | 319       | 0                | 0         | 0  | 659.999                       | 482       | 0                | 7.001     | 0  | 0,00       | 0,99     | 0,00                    |
| BANCAJA 11, FTA                         | 797.753                          | 526       | 0                | 0         | 0  | 534.891                       | 697       | 0                | 5.538     | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| BANCAJA 13, FTA                         | 2.072.956                        | 2.031     | 0                | 0         | 0  | 311.300                       | 673       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 7,32     | 0,00                    |
| BANCAJA 3, FTA                          | 139.922                          | 14        | 0                | 0         | 0  | 15.997                        | 16        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,68     | 0,00                    |
| BANCAJA 4, FTH                          | 166.458                          | 28        | 0                | 0         | 0  | 11.186                        | 4         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,27     | 0,00                    |
| BANCAJA 5, FTA                          | 190.935                          | 190       | 0                | 0         | 0  | 16.377                        | 37        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,46     | 0,00                    |
| BANCAJA 6, FTA                          | 388.820                          | 200       | 0                | 0         | 0  | 76.264                        | 92        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 4,51     | 0,00                    |
| BANCAJA 7, FTA                          | 518.307                          | 191       | 0                | 0         | 0  | 50.755                        | 58        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,30     | 0,00                    |
| BANCAJA 8, FTA                          | 528.487                          | 312       | 0                | 0         | 0  | 116.400                       | 313       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 4,57     | 0,00                    |
| BANCAJA 9, FTA                          | 791.971                          | 34        | 0                | 0         | 0  | 122.600                       | 28        | 0                | 6.237     | 0  | 0,00       | 2,23     | 0,00                    |
| BANCAJA LEASING 1, FTA                  | 235.831                          | 47        | 0                | 0         | 0  | 224.000                       | 75        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 28,67    | 0,00                    |
| BANKINTER 10, FTA                       | 693.332                          | 73        | 0                | 0         | 0  | 73.566                        | 43        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,61     | 0,00                    |

| FONDO                   | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |           |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |           |                  |           |  | MEJORAS    |          |                         |
|-------------------------|----------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|-------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|------------|----------|-------------------------|
|                         | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1) | % FR (2) | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|                         | PRINCIPAL                        | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  |            |          |                         |
| BANKINTER 11, FTH       | 412.853                          | 156       | 0                | 0         | 0  | 53.200                        | 107       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,79     | 0,00                    |
| BANKINTER 12, FTH       | 572.267                          | 73        | 0                | 0         | 0  | 47.600                        | 35        | 0                | 119       | 0  | 0,00       | 1,82     | 0,00                    |
| BANKINTER 13 FTA        | 843.790                          | 639       | 0                | 0         | 0  | 87.600                        | 343       | 0                | 2.422     | 0  | 0,00       | 2,22     | 0,00                    |
| BANKINTER 2 PYME FTA    | 154.058                          | 61        | 0                | 0         | 0  | 69.000                        | 141       | 0                | 2.340     | -45  | 0,00       | 4,24     | 0,00                    |
| BANKINTER 2, FTH        | 34.393                           | 154       | 0                | 0         | 0  | 3.200                         | 18        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| BANKINTER 3 FTPYME FTA  | 149.150                          | 70        | 0                | 0         | 0  | 117.090                       | 148       | 0                | 3.022     | 0  | 22,46      | 3,59     | 0,00                    |
| BANKINTER 3, FTH        | 214.720                          | 216       | 0                | 0         | 0  | 24.776                        | 70        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,76     | 0,00                    |
| BANKINTER 4 FTPYME, FTA | 20.343                           | 22        | 0                | 0         | 0  | 172.665                       | 210       | 0                | 0         | 0  | 59,00      | 15,19    | 0,00                    |
| BANKINTER 4, FTH        | 224.356                          | 130       | 0                | 0         | 0  | 24.156                        | 38        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,16     | 0,00                    |
| BANKINTER 5, FTH        | 162.005                          | 98        | 0                | 0         | 0  | 12.758                        | 18        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,50     | 0,00                    |
| BANKINTER 6, FTA        | 397.448                          | 167       | 0                | 0         | 0  | 35.031                        | 41        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,18     | 0,00                    |
| BANKINTER 7, FTH        | 142.831                          | 7         | 0                | 0         | 0  | 11.414                        | 2         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,20     | 0,00                    |
| BANKINTER 8, FTA        | 317.258                          | 47        | 0                | 0         | 0  | 26.095                        | 10        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,14     | 0,00                    |
| BANKINTER 9, FTA        | 397.186                          | 271       | 0                | 0         | 0  | 41.253                        | 75        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,15     | 0,00                    |
| BBVA AUTOS 1 FTA        | 10.081                           | 2         | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 218,79   | 0,00                    |
| BBVA AUTOS 2 FTA        | 61.914                           | 22        | 0                | 0         | 0  | 50.500                        | 24        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 15,28    | 0,00                    |
| BBVA CONSUMO 1, FTA     | 99.283                           | 60        | 0                | 0         | 0  | 52.500                        | 39        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 16,33    | 0,00                    |
| BBVA CONSUMO 2, FTA     | 138.124                          | 15        | 0                | 0         | 0  | 59.300                        | 8         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 12,38    | 0,00                    |
| BBVA CONSUMO 3 FTA      | 141.271                          | 77        | 0                | 0         | 0  | 58.500                        | 64        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 9,22     | 0,00                    |
| BBVA CONSUMO 4 FTA      | 299.333                          | 32        | 0                | 0         | 0  | 162.300                       | 36        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 53,48    | 0,00                    |
| BBVA CONSUMO 5, FTA     | 653.198                          | 365       | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 70,24    | 0,00                    |
| BBVA EMPRESAS 1, FTA    | 20.774                           | 7         | 0                | 0         | 0  | 190.636                       | 319       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 12,79    | 0,00                    |
| BBVA EMPRESAS 2, FTA    | 492.242                          | 309       | 0                | 0         | 0  | 433.200                       | 489       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 51,65    | 0,00                    |
| BBVA EMPRESAS 3, FTA    | 334.657                          | 36        | 0                | 0         | 0  | 390.000                       | 68        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 56,95    | 0,00                    |
| BBVA EMPRESAS 4, FTA    | 639.461                          | 339       | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 102,20   | 0,00                    |
| BBVA EMPRESAS 5, FTA    | 416.536                          | 101       | 0                | 0         | 0  | 275.000                       | 94        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 37,17    | 0,00                    |

| FONDO                              | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |           |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |           |                  |           |  | MEJORAS    |          |                         |
|------------------------------------|----------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|-------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|------------|----------|-------------------------|
|                                    | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1) | % FR (2) | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|                                    | PRINCIPAL                        | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  |            |          |                         |
| BBVA EMPRESAS 6, FTA               | 510.687                          | 336       | 0                | 0         | 0  | 396.000                       | 448       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 17,10    | 0,00                    |
| BBVA FINANZIA AUTOS 1 FTA          | 67.918                           | 40        | 0                | 0         | 0  | 56.000                        | 60        | 0                | 0         | -8.336   | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| BBVA HIPOTECARIO 3, FTA            | 115.619                          | 48        | 0                | 0         | 0  | 62.258                        | 41        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 8,15     | 0,00                    |
| BBVA LEASING 1, FTA                | 284.675                          | 106       | 0                | 0         | 0  | 143.800                       | 111       | 0                | 1.033     | -70.677  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| BBVA RMBS 1, FTA                   | 871.465                          | 99        | 0                | 0         | 0  | 700.000                       | 115       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| BBVA RMBS 10, FTA                  | 1.311.816                        | 1.307     | 0                | 0         | 0  | 224.000                       | 311       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 12,60    | 0,00                    |
| BBVA RMBS 11, FTA                  | 1.189.045                        | 1.185     | 0                | 0         | 0  | 196.000                       | 333       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 16,08    | 0,00                    |
| BBVA RMBS 2, FTA                   | 1.453.286                        | 195       | 0                | 0         | 0  | 1.650.000                     | 280       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| BBVA RMBS 3, FTA                   | 538.961                          | 221       | 0                | 0         | 0  | 1.667.257                     | 912       | 0                | 0         | -30.096  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| BBVA RMBS 5 FTA                    | 3.148.007                        | 508       | 0                | 0         | 0  | 325.000                       | 106       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 9,65     | 0,00                    |
| BBVA RMBS 9, FTA                   | 1.159.438                        | 187       | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 22,94    | 0,00                    |
| BBVA-3 FTPYME FTA                  | 20.157                           | 8         | 0                | 0         | 0  | 25.708                        | 31        | 0                | 0         | 0  | 43,95      | 25,56    | 0,00                    |
| BBVA-4 PYME, FTA                   | 31.534                           | 14        | 0                | 0         | 0  | 26.784                        | 25        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,16     | 0,00                    |
| BBVA-5 FTPYME, FTA                 | 74.609                           | 8         | 0                | 0         | 0  | 96.900                        | 12        | 0                | 0         | 0  | 4,71       | 0,00     | 0,00                    |
| BBVA-6 FTPYME FTA                  | 44.520                           | 3         | 0                | 0         | 0  | 176.425                       | 16        | 0                | 652       | -6.940   | 42,47      | 0,00     | 0,00                    |
| BBVA-7 FTGENCAT, FTA               | 22.312                           | 13        | 0                | 0         | 0  | 25.700                        | 42        | 0                | 0         | 0  | 46,47      | 0,53     | 0,00                    |
| BBVA-8 FTPYME FTA                  | 143.004                          | 29        | 0                | 0         | 0  | 110.000                       | 44        | 0                | 0         | 0  | 56,52      | 3,00     | 0,00                    |
| BBVA-9 PYME FTA                    | 400.000                          | 22        | 0                | 0         | 0  | 70.000                        | 5         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 18,21    | 0,00                    |
| BCL MUNICIPIOS 1 FTA               | 42.188                           | 24        | 0                | 0         | 0  | 60.000                        | 78        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 31,21    | 0,00                    |
| CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA           | 451.876                          | 270       | 0                | 0         | 0  | 50.000                        | 55        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,03     | 0,24                    |
| CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA           | 391.302                          | 343       | 0                | 0         | 0  | 23.700                        | 66        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 4,07     | 0,00                    |
| CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA | 93.415                           | 49        | 0                | 0         | 0  | 134.500                       | 158       | 0                | 0         | 0  | 21,56      | 19,23    | 0,00                    |
| CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA     | 147.374                          | 5         | 0                | 0         | 0  | 64.000                        | 4         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 6,41     | 0,00                    |
| CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA         | 203.456                          | 97        | 0                | 0         | 0  | 10.800                        | 14        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 11,40    | 0,00                    |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, FTA | 2.000.000                        | 57.611    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 5, FTA | 2.350.000                        | 69.031    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |

| FONDO  | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |           |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |           |                  |           |  | MEJORAS    |          |                         |
|--|----------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|-------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|------------|----------|-------------------------|
|  | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1) | % FR (2) | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|  | PRINCIPAL                        | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  |            |          |                         |
| CEDULAS TDA 15, FTA  | 1.327.002                        | 24.881    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 4,21                    |
| CEDULAS TDA 17, FTA  | 1.150.000                        | 9.675     | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 6,81                    |
| CEDULAS TDA 18, FTA  | 800.000                          | 20.405    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 7,45                    |
| CEDULAS TDA 2, FTA   | 2.000.000                        | 8.630     | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,93     | 0,00                    |
| CEDULAS TDA 21, FONDO DE TITULIZACION                      | 2.650.000                        | 1.237     | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 9,10                    |
| CEDULAS TDA 3, FTA   | 2.000.000                        | 72.356    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,05     | 0,00                    |
| CEDULAS TDA 5, FTA   | 1.500.000                        | 5.425     | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 3,85                    |
| CEDULAS TDA 6, FTA   | 3.000.000                        | 70.705    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 2,79                    |
| CEDULAS TDA 7, FTA   | 2.000.000                        | 37.205    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 2,15                    |
| CIBELES III FTPYME, FTA                                    | 13.230                           | 5         | 0                | 0         | 0  | 28.307                        | 52        | 0                | 0         | 0  | 31,85      | 42,44    | 48,01                   |
| CM BANCAJA 1, FTA  | 36.902                           | 13        | 0                | 2.086     | 0  | 49.143                        | 13        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 16,84    | 0,00                    |
| CONSUMO BANCAJA 1, FTA                                     | 3.528                            | 1         | 0                | 0         | 0  | 32.100                        | 62        | 0                | 2.731     | -17.669  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| DRIVER ESPAÑA ONE, FTA                                     | 226.210                          | 85        | 0                | 0         | 0  | 32.230                        | 26        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,71     | 0,00                    |
| EDT FTPYME PASTOR 3, FTA                                   | 21.453                           | 12        | 0                | 0         | 0  | 15.400                        | 86        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 9,52     | 0,00                    |
| EMPRESAS BANESTO 2, FTA                                    | 340.606                          | 360       | 0                | 360       | 0  | 166.000                       | 354       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 23,45    | 0,00                    |
| EMPRESAS BANESTO 5, FTA                                    | 401.528                          | 177       | 0                | 0         | 0  | 256.000                       | 241       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 42,12    | 0,00                    |
| EMPRESAS BANESTO 6, FTA                                    | 500.333                          | 184       | 0                | 0         | 0  | 429.000                       | 225       | 0                | 0         | -3.586   | 0,00       | 40,59    | 0,00                    |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 3, FTA                        | 150.933                          | 101       | 0                | 0         | 0  | 59.300                        | 83        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 5, FTA                        | 496.901                          | 328       | 0                | 7.882     | 0  | 105.000                       | 118       | 0                | 400       | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| FTA PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZ. DE CED. HIPOTECARIA | 1.200.000                        | 27.725    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| FINANCAT 1, FTA  | 46.918                           | 90        | 4.202            | 0         | 0  | 105.000                       | 530       | 0                | 4.864     | -45.922  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| FINANCIACION BANESTO 1, FTA                                | 1.868                            | 1         | 0                | 0         | 0  | 40.000                        | 42        | 0                | 0         | -1.992   | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| FONCAIXA AUTONOMOS 1, FTA                                  | 762.196                          | 1.732     | 0                | 0         | 0  | 169.500                       | 705       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 18,10    | 0,00                    |
| FONCAIXA CONSUMO 1, FTA                                    | 2.018.777                        | 1.133     | 0                | 0         | 0  | 462.000                       | 413       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 6,32     | 0,00                    |
| FONCAIXA EMPRESAS 3, FTA                                   | 698.214                          | 1.587     | 0                | 0         | 0  | 280.000                       | 1.165     | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 14,96    | 0,00                    |

| FONDO                                    | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |           |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |           |                  |           |  | MEJORAS    |          |                         |
|--|----------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|-------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|------------|----------|-------------------------|
|  | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1) | % FR (2) | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|  | PRINCIPAL                        | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  |            |          |                         |
| FONCAIXA FTGENCAT 3, FTA                 | 137.188                          | 10        | 0                | 0         | 0  | 31.500                        | 19        | 0                | 147       | -2.049   | 81,33      | 3,49     | 2,02                    |
| FONCAIXA FTGENCAT 4, FTA                 | 184.503                          | 85        | 0                | 0         | 0  | 23.476                        | 83        | 0                | 158       | -459   | 88,71      | 2,59     | 1,90                    |
| FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA                 | 481.902                          | 356       | 0                | 0         | 0  | 64.000                        | 336       | 0                | 4.716     | -14.476  | 82,32      | 3,83     | 0,00                    |
| FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA                 | 350.223                          | 80        | 0                | 0         | 0  | 41.300                        | 48        | 0                | 3.059     | -10.024  | 74,38      | 3,68     | 0,00                    |
| FONCAIXA LEASINGS 1, FTA                 | 669.650                          | 264       | 0                | 0         | 0  | 212.500                       | 120       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 24,54    | 0,00                    |
| FONCAIXA PYMES 3, FTA                    | 2.040.000                        | 1.177     | 0                | 0         | 0  | 360.000                       | 280       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 10,60    | 0,00                    |
| FTA FTPYME SANTANDER 1                   | 0                                | 0         | 0                | 0         | 0  | 255.320                       | 315       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 7,27     | 0,00                    |
| FTA FTPYME SANTANDER 2                   | 104.537                          | 89        | 0                | 89        | 0  | 229.782                       | 419       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,56     | 0,00                    |
| FTA PYMES SANTANDER 3                    | 1.161.032                        | 1.285     | 0                | 0         | 0  | 580.900                       | 895       | 0                | 0         | -3.968   | 0,00       | 25,37    | 0,00                    |
| FTA PYMES SANTANDER 4                    | 2.252.500                        | 1.416     | 0                | 0         | 0  | 927.500                       | 820       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 22,55    | 19,17                   |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 07-1   | 77.070                           | 9         | 0                | 9         | 0  | 138.000                       | 73        | 0                | 5.738     | -20.532  | 0,00       | 20,39    | 0,00                    |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2011-1 | 466.338                          | 866       | 0                | 0         | 0  | 252.500                       | 436       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 20,53    | 0,00                    |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2012-1 | 425.000                          | 1.381     | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 10,21    | 0,00                    |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 10, FTA           | 979.718                          | 1.178     | 0                | 0         | 0  | 1.880.000                     | 2.441     | 0                | 2.400     | -83.914  | 0,00       | 55,99    | 22,99                   |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 2                 | 84.980                           | 35        | 0                | 0         | 0  | 288.600                       | 249       | 0                | 2.821     | -9.415   | 0,00       | 12,24    | 0,00                    |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 4                 | 446.101                          | 527       | 94.190           | 0         | 0  | 369.900                       | 1.034     | 0                | 6.939     | -125.587   | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 8, FTA            | 1.094.731                        | 1.545     | 0                | 0         | 0  | 2.725.100                     | 8.389     | 0                | 21.794    | -319.378   | 0,00       | 55,49    | 11,18                   |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 9, FTA            | 543.180                          | 143       | 0                | 0         | 0  | 2.193.500                     | 1.277     | 0                | 10.240    | -154.642   | 0,00       | 64,18    | 7,21                    |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 1             | 23.947                           | 17        | 0                | 0         | 0  | 175.800                       | 348       | 0                | 5.245     | -51.942  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 5             | 287.319                          | 54        | 0                | 0         | 0  | 505.300                       | 234       | 0                | 1.140     | -13.017  | 0,00       | 35,52    | 0,00                    |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2              | 768.272                          | 573       | 0                | 0         | 0  | 171.100                       | 301       | 0                | 2.561     | -10.453  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3              | 1.478.967                        | 1.060     | 0                | 0         | 0  | 249.100                       | 407       | 0                | 2.732     | -144.307   | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 6              | 596.218                          | 456       | 0                | 0         | 0  | 388.500                       | 497       | 0                | 4.453     | -19.981  | 0,00       | 22,90    | 0,00                    |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 7              | 1.167.028                        | 405       | 0                | 0         | 0  | 719.700                       | 347       | 0                | 0         | -6.730   | 0,00       | 23,83    | 0,00                    |



| FONDO  | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |           |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |           |                  |           |  | MEJORAS    |          |                         |
|--|----------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|-------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|------------|----------|-------------------------|
|  | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1) | % FR (2) | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|  | PRINCIPAL                        | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  |            |          |                         |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 8                                  | 540.104                          | 594       | 0                | 0         | 0  | 320.000                       | 425       | 0                | 0         | -2.265   | 0,00       | 23,28    | 0,00                    |
| FTA SANTANDER PUBLICO 1                                      | 292.459                          | 158       | 0                | 158       | 0  | 12.186                        | 13        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 4,82     | 0,00                    |
| FTA UCI 11   | 222.264                          | 30        | 0                | 0         | 0  | 28.900                        | 10        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,03     | 0,00                    |
| FTA UCI 14   | 542.840                          | 60        | 0                | 0         | 0  | 72.500                        | 15        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,39     | 0,00                    |
| FTA UCI 16   | 902.069                          | 125       | 0                | 0         | 0  | 142.200                       | 56        | 0                | 3.754     | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| FTA UCI 18   | 1.050.296                        | 221       | 0                | 0         | 0  | 82.500                        | 45        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,02     | 0,00                    |
| FTA UCI 6  | 45.748                           | 28        | 0                | 0         | 0  | 4.570                         | 6         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 9,19     | 0,00                    |
| FTA UCI 7  | 57.476                           | 10        | 0                | 0         | 0  | 4.023                         | 2         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,55     | 0,00                    |
| FTA UCI 8  | 78.350                           | 12        | 0                | 0         | 0  | 5.171                         | 2         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 7,18     | 0,00                    |
| FTA UCI 9  | 210.549                          | 35        | 0                | 0         | 0  | 19.057                        | 6         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,40     | 0,00                    |
| FTA, HIPOTEBANSA 11  | 219.496                          | 124       | 0                | 0         | 0  | 13.170                        | 11        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,02     | 0,00                    |
| FTA, HIPOTEBANSA X   | 126.836                          | 19        | 0                | 0         | 0  | 8.879                         | 3         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,01     | 0,00                    |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 1                                    | 0                                | 0         | 0                | 0         | 0  | 336.088                       | 331       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 7,16     | 0,00                    |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 3                                    | 405.564                          | 350       | 0                | 0         | 0  | 318.000                       | 617       | 0                | 3.476     | -12.311  | 0,00       | 3,41     | 0,00                    |
| FTA, UCI 15  | 625.624                          | 79        | 0                | 0         | 0  | 111.000                       | 28        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,90     | 0,00                    |
| FTA, UCI 17  | 809.138                          | 116       | 0                | 0         | 0  | 116.200                       | 40        | 0                | 3.550     | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA | 15.503.300                       | 383.545   | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 1,42       | 0,00     | 13,87                   |
| FTH UCI 10   | 161.738                          | 12        | 0                | 12        | 0  | 10.324                        | 2         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,53     | 0,00                    |
| FTH UCI 12   | 308.852                          | 43        | 0                | 0         | 0  | 32.800                        | 10        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,96     | 0,00                    |
| FTH UCI 5  | 20.061                           | 11        | 0                | 0         | 0  | 2.650                         | 3         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 11,81    | 0,00                    |
| FTPyme BANCAJA 2 FTA   | 18.061                           | 10        | 0                | 0         | 0  | 16.542                        | 40        | 0                | 0         | 0  | 52,20      | 11,04    | 52,62                   |
| FTPyme BANCAJA 3 FTA   | 13.100                           | 1         | 0                | 0         | 0  | 40.542                        | 19        | 0                | 0         | 0  | 24,42      | 2,10     | 22,27                   |
| FTPyme BANCAJA 6 FTA   | 28.427                           | 2         | 0                | 0         | 0  | 167.355                       | 27        | 0                | 5.306     | -11.416  | 35,94      | 0,00     | 0,00                    |
| FTPyme TDA 6, FTA  | 12.232                           | 0         | 0                | 0         | 0  | 7.558                         | 1         | 0                | 0         | 0  | 61,81      | 1,43     | 1,35                    |
| FTPyme TDA 7, FTA  | 43.738                           | 2         | 0                | 0         | 0  | 41.800                        | 9         | 0                | 1.066     | -5.526   | 21,39      | 4,10     | 0,00                    |

| FONDO                              | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |           |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |           |                  |           |  | MEJORAS    |          |                         |
|------------------------------------|----------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|-------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|------------|----------|-------------------------|
|                                    | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1) | % FR (2) | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|                                    | PRINCIPAL                        | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  |            |          |                         |
| FTPYME TDA CAM 2, FTA              | 42.281                           | 16        | 0                | 0         | 0  | 35.200                        | 40        | 0                | 0         | 0  | 54,57      | 5,58     | 1,27                    |
| FTPYME TDA CAM 4, FTA              | 133.569                          | 4         | 0                | 0         | 0  | 241.296                       | 18        | 0                | 7.715     | 0  | 28,81      | 0,17     | 0,00                    |
| FTPYME TDA CAM 7, FTA              | 150.776                          | 72        | 0                | 0         | 0  | 350.561                       | 269       | 0                | 0         | 0  | 28,60      | 7,11     | 0,00                    |
| FTPYME TDA CAM 9, FTA              | 199.060                          | 105       | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 100,00     | 11,43    | 0,00                    |
| GAT FTGENCAT 2005, FTA             | 15.895                           | 8         | 0                | 0         | 0  | 48.867                        | 69        | 0                | 0         | 0  | 24,54      | 24,00    | 0,00                    |
| GAT FTGENCAT 2006, FTA             | 36.337                           | 3         | 0                | 0         | 0  | 40.100                        | 27        | 0                | 2.635     | -12.431  | 47,53      | 0,45     | 0,00                    |
| GAT FTGENCAT 2007, FTA             | 96.848                           | 14        | 1.707            | 0         | 0  | 86.300                        | 66        | 0                | 6.405     | -42.022  | 53,31      | 0,00     | 0,00                    |
| GAT FTGENCAT 2008, FTA             | 150.916                          | 200       | 0                | 0         | 0  | 145.800                       | 440       | 0                | 0         | -4.566   | 24,08      | 5,79     | 0,00                    |
| GAT FTGENCAT 2009, FTA             | 69.985                           | 21        | 940              | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 79,33      | 13,07    | 0,00                    |
| GAT ICO-FTVPO 1, FTH               | 223.493                          | 51        | 0                | 0         | 0  | 37.900                        | 32        | 0                | 27        | 0  | 85,50      | 4,68     | 0,00                    |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 1, FTA  | 89.741                           | 42        | 0                | 0         | 0  | 27.058                        | 46        | 0                | 53        | -5.862   | 76,83      | 3,44     | 0,00                    |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 2, FTA  | 40.082                           | 11        | 0                | 0         | 0  | 110.000                       | 107       | 0                | 2.124     | -3.914   | 26,71      | 34,09    | 0,00                    |
| GC FTGENCAT CAIXA TARRAGONA 1, FTA | 83.281                           | 103       | 0                | 0         | 0  | 56.300                        | 204       | 0                | 2.044     | -8.155   | 28,16      | 8,67     | 0,00                    |
| GC FTGENCAT SABADELL 1, FTA        | 72.190                           | 6         | 0                | 0         | 0  | 25.500                        | 6         | 0                | 0         | 0  | 73,90      | 6,91     | 0,00                    |
| GC FTPYME PASTOR 4, FTA            | 26.248                           | 13        | 138              | 0         | 0  | 63.000                        | 132       | 0                | 92        | -7.326   | 29,52      | 0,00     | 0,00                    |
| GC FTPYME SABADELL 4, FTA          | 72.957                           | 4         | 0                | 0         | 0  | 38.300                        | 8         | 0                | 0         | 0  | 65,58      | 3,79     | 0,00                    |
| GC FTPYME SABADELL 5, FTA          | 163.936                          | 93        | 0                | 0         | 0  | 66.900                        | 86        | 0                | 0         | 0  | 35,87      | 3,96     | 0,00                    |
| GC FTPYME SABADELL 6, FTA          | 203.179                          | 107       | 0                | 0         | 0  | 55.500                        | 82        | 0                | 0         | 0  | 51,84      | 1,99     | 0,00                    |
| GC FTPYME SABADELL 8, FTA          | 355.786                          | 1.100     | 0                | 0         | 0  | 200.000                       | 673       | 0                | 0         | 0  | 35,23      | 16,11    | 0,00                    |
| GC FTPYME UNNIM 1, FTA             | 81.811                           | 26        | 0                | 0         | 0  | 137.500                       | 168       | 0                | 0         | 0  | 24,76      | 13,05    | 0,00                    |
| GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA       | 363.515                          | 41        | 13.900           | 0         | 0  | 42.700                        | 19        | 0                | 1.847     | -20.235  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| GC SABADELL 1, FTH                 | 338.250                          | 40        | 0                | 0         | 0  | 18.667                        | 4         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,89     | 0,00                    |
| GC SABADELL EMPRESAS 2, FTA        | 201.999                          | 62        | 0                | 0         | 0  | 52.500                        | 34        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,50     | 0,00                    |
| GC SABADELL EMPRESAS 4, FTA        | 142.043                          | 43        | 0                | 0         | 0  | 94.200                        | 71        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 26,33    | 0,00                    |
| HIPOCAT 10, FTA                    | 574.001                          | 387       | 5.494            | 0         | 0  | 132.100                       | 363       | 0                | 8.740     | -30.922  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| HIPOCAT 11, FTA                    | 578.342                          | 475       | 53.338           | 0         | 0  | 144.800                       | 438       | 0                | 11.237    | -82.037  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |

| FONDO                           | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |           |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |           |                  |           |  | MEJORAS    |          |                         |
|---------------------------------|----------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|-------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|------------|----------|-------------------------|
|                                 | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1) | % FR (2) | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|                                 | PRINCIPAL                        | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  |            |          |                         |
| HIPOCAT 14, FTA                 | 363.774                          | 119       | 0                | 0         | 0  | 40.158                        | 36        | 0                | 0         | -410   | 0,00       | 2,21     | 0,00                    |
| HIPOCAT 16, FTA                 | 572.761                          | 115       | 0                | 0         | 0  | 43.500                        | 19        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,77     | 0,00                    |
| HIPOCAT 17, FTA                 | 640.881                          | 103       | 0                | 0         | 0  | 29.200                        | 12        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,19     | 0,00                    |
| HIPOCAT 18, FTA                 | 556.526                          | 554       | 0                | 0         | 0  | 62.300                        | 137       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 9,35     | 6,32                    |
| HIPOCAT 19, FTA                 | 381.089                          | 52        | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,47     | 3,94                    |
| HIPOCAT 20, FTA                 | 502.825                          | 69        | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 7,19     | 4,11                    |
| HIPOCAT 4, FTA                  | 45.820                           | 9         | 0                | 0         | 0  | 9.090                         | 3         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,51     | 0,00                    |
| HIPOCAT 5, FTA                  | 124.953                          | 125       | 0                | 0         | 0  | 19.693                        | 29        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,34     | 0,00                    |
| HIPOCAT 6, FTA                  | 181.699                          | 35        | 0                | 0         | 0  | 26.126                        | 11        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 7,65     | 0,00                    |
| HIPOCAT 7, FTA                  | 387.987                          | 319       | 0                | 0         | 0  | 67.278                        | 102       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,45     | 12,04                   |
| HIPOCAT 8, FTA                  | 473.759                          | 64        | 0                | 0         | 0  | 89.301                        | 18        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,05     | 0,00                    |
| HIPOCAT 9, FTA                  | 373.476                          | 275       | 0                | 0         | 0  | 79.800                        | 239       | 0                | 3.826     | 0  | 0,00       | 2,90     | 0,00                    |
| ICO MEDIACION I AYT, FTA        | 363.780                          | 13        | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 15,79                   |
| ICO MEDIACION II AYT FTA        | 3.592.612                        | 2.750     | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 75,97    | 0,00                    |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 1, FTA  | 102.365                          | 37        | 0                | 0         | 0  | 79.176                        | 128       | 0                | 0         | 0  | 56,36      | 2,44     | 0,00                    |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 2, FTA  | 292.966                          | 384       | 0                | 0         | 0  | 83.000                        | 148       | 0                | 0         | 0  | 77,92      | 16,78    | 0,00                    |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 3, FTA  | 593.501                          | 50        | 0                | 0         | 0  | 325.000                       | 102       | 0                | 0         | 0  | 54,43      | 22,75    | 0,00                    |
| IM BANCO POPULAR MBS 2, FTA     | 484.725                          | 45        | 0                | 0         | 0  | 89.000                        | 29        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 9,04     | 0,00                    |
| IM BANKOA MBS 1, FTA            | 356.329                          | 33        | 0                | 0         | 0  | 37.100                        | 7         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 6,78     | 0,00                    |
| IM BCG RMBS 1, FTA              | 318.924                          | 30        | 0                | 0         | 0  | 12.000                        | 1         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,47     | 0,00                    |
| IM BES EMPRESAS 1, FTA          | 129.769                          | 16        | 0                | 0         | 0  | 242.500                       | 38        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 6,73     | 0,00                    |
| IM CAJA LABORAL 1, FTA          | 411.224                          | 271       | 0                | 0         | 0  | 54.500                        | 123       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,44     | 0,00                    |
| IM CAJA LABORAL 2, FTA          | 406.151                          | 381       | 0                | 0         | 0  | 75.600                        | 138       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 4,55     | 0,00                    |
| IM CAJA LABORAL EMPRESAS 1, FTA | 194.195                          | 24        | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 9,90     | 0,00                    |
| IM CAJAMAR 1, FTA               | 105.202                          | 77        | 0                | 0         | 0  | 16.700                        | 39        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,84     | 0,00                    |
| IM CAJAMAR 3, FTA               | 525.615                          | 32        | 0                | 0         | 0  | 45.991                        | 8         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,00     | 0,00                    |

| FONDO                                  | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |           |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |           |                  |           |  | MEJORAS    |          |                         |
|--|----------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|-------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|------------|----------|-------------------------|
|  | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1) | % FR (2) | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|  | PRINCIPAL                        | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  |            |          |                         |
| IM CAJAMAR 4, FTA                      | 516.917                          | 31        | 0                | 0         | 0  | 50.500                        | 15        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,13     | 0,00                    |
| IM CAJAMAR 5, FTA                      | 608.435                          | 45        | 0                | 0         | 0  | 53.000                        | 18        | 0                | 2.856     | 0  | 0,00       | 2,19     | 0,00                    |
| IM CAJAMAR 6, FTA                      | 1.245.656                        | 115       | 0                | 0         | 0  | 163.800                       | 56        | 0                | 10.488    | 0  | 0,00       | 1,60     | 0,00                    |
| IM CAJAMAR EMPRESAS 2 FTPYME, FTA      | 79.559                           | 149       | 0                | 0         | 0  | 69.600                        | 149       | 0                | 0         | 0  | 53,33      | 21,16    | 0,00                    |
| IM CAJAMAR EMPRESAS 4, FTA             | 670.456                          | 84        | 0                | 0         | 0  | 284.193                       | 64        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 10,93    | 0,00                    |
| IM CAJASTUR MBS 1, FTA                 | 421.045                          | 53        | 0                | 0         | 0  | 123.000                       | 27        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 15,32    | 0,00                    |
| IM CEDULAS 1 GRUPO BANCO POPULAR, FTA  | 2.000.000                        | 75.083    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| IM CEDULAS 10, FTA                     | 1.300.000                        | 50.213    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 3,24                    |
| IM CEDULAS 14, FTA                     | 1.200.000                        | 29.250    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| IM CEDULAS 15, FTA                     | 800.000                          | 770       | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| IM CEDULAS 2, FTA                      | 1.475.000                        | 36.691    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 5,43                    |
| IM CEDULAS 3, FTA                      | 1.060.000                        | 4.829     | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 4,87                    |
| IM CEDULAS 4, FTA                      | 2.075.000                        | 62.682    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 2,82                    |
| IM CEDULAS 5, FTA                      | 1.250.000                        | 23.698    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 3,10                    |
| IM CEDULAS 7, FTA                      | 1.250.000                        | 37.639    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 3,74                    |
| IM CEDULAS 9, FTA                      | 1.275.000                        | 30.255    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 3,75                    |
| IM CFS RMBS 1, FTA                     | 283.500                          | 30        | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,00     | 0,00                    |
| IM CITI TARJETAS 1, FTA                | 840.000                          | 69        | 0                | 0         | 0  | 160.000                       | 18        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA            | 150.569                          | 70        | 0                | 0         | 0  | 25.500                        | 32        | 0                | 0         | 0  | 85,51      | 0,74     | 0,00                    |
| IM FTGENCAT SABADELL 3, FTA            | 63.078                           | 9         | 0                | 0         | 0  | 23.700                        | 16        | 0                | 0         | 0  | 72,68      | 5,64     | 0,00                    |
| IM FTGENCAT SABADELL 4, FTA            | 92.745                           | 133       | 0                | 0         | 0  | 70.900                        | 241       | 0                | 0         | 0  | 56,63      | 15,55    | 0,00                    |
| IM FTPYME SABADELL 3, FTA              | 40.311                           | 15        | 0                | 0         | 0  | 21.493                        | 29        | 0                | 0         | 0  | 65,20      | 7,48     | 0,00                    |
| IM FTPYME SABADELL 7, FTA              | 230.419                          | 30        | 0                | 0         | 0  | 100.000                       | 31        | 0                | 0         | 0  | 69,73      | 12,32    | 0,00                    |
| IM FTPYME SABADELL 9, FTA              | 621.154                          | 659       | 0                | 0         | 0  | 555.000                       | 1.398     | 0                | 0         | 0  | 52,78      | 13,85    | 0,00                    |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, FTA | 171.043                          | 15        | 0                | 0         | 0  | 143.100                       | 54        | 0                | 5.517     | 0  | 0,00       | 14,59    | 0,00                    |

| FONDO                                  | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |           |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |           |                  |           |  | MEJORAS    |          |                         |
|--|----------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|-------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|------------|----------|-------------------------|
|  | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1) | % FR (2) | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|  | PRINCIPAL                        | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  |            |          |                         |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 3, FTA | 1.642.500                        | 17.342    | 0                | 0         | 0  | 607.500                       | 10.148    | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 24,48    | 0,00                    |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 4, FTA | 508.124                          | 63        | 0                | 0         | 0  | 625.000                       | 205       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 39,77    | 0,00                    |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I FTA    | 278.633                          | 20        | 0                | 0         | 0  | 148.000                       | 53        | 0                | 3.472     | 0  | 36,13      | 10,13    | 0,00                    |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME II, FTA  | 155.459                          | 59        | 0                | 0         | 0  | 154.000                       | 443       | 0                | 12.669    | 0  | 48,20      | 9,52     | 0,00                    |
| IM GRUPO BANCO POPULAR LEASING 2, FTA  | 558.287                          | 83        | 0                | 0         | 0  | 225.000                       | 80        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 41,51    | 0,00                    |
| IM PASTOR 2, FTH                       | 226.637                          | 16        | 0                | 0         | 0  | 38.000                        | 9         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,08     | 0,00                    |
| IM PASTOR 3, FTH                       | 309.032                          | 19        | 0                | 0         | 0  | 39.000                        | 5         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| IM PASTOR 4, FTA                       | 390.135                          | 24        | 0                | 0         | 0  | 34.000                        | 5         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, FTA       | 178.692                          | 125       | 0                | 0         | 0  | 4.051                         | 10        | 0                | 0         | -2.466   | 0,00       | 2,95     | 22,21                   |
| IM SABADELL EMPRESAS 1, FTA            | 127.186                          | 133       | 0                | 0         | 0  | 61.000                        | 253       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,73     | 0,00                    |
| IM SABADELL EMPRESAS 3, FTA            | 283.197                          | 325       | 0                | 0         | 0  | 330.600                       | 947       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 43,05    | 0,00                    |
| IM SABADELL EMPRESAS 5, FTA            | 18.520                           | 27        | 0                | 0         | 0  | 216.000                       | 769       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 38,06    | 0,00                    |
| IM SABADELL RMBS 2, FTA                | 819.645                          | 1.030     | 0                | 0         | 0  | 35.000                        | 114       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,00     | 0,00                    |
| IM SABADELL RMBS 3, FTA                | 907.567                          | 174       | 0                | 0         | 0  | 28.800                        | 12        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 4,22     | 0,00                    |
| IM TERRASSA 1 FTGENCAT FTA             | 18.192                           | 9         | 0                | 0         | 0  | 30.320                        | 48        | 0                | 0         | 0  | 37,48      | 24,06    | 0,00                    |
| IM TERRASSA MBS 1, FTA                 | 188.669                          | 135       | 0                | 0         | 0  | 31.600                        | 36        | 0                | 0         | -285   | 0,00       | 2,24     | 0,00                    |
| INTERMONEY MASTER CEDULAS, FTA         | 1.655.000                        | 4.666     | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 2,85                    |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS III, FTA   | 257.594                          | 88        | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 21,66    | 0,89                    |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS IV, FTA    | 287.018                          | 270       | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 26,05    | 0,00                    |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS V, FTA     | 584.895                          | 1.390     | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 4,17     | 0,00                    |
| MADRID CONSUMO I, FTA                  | 96.793                           | 62        | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 20,44    | 0,00                    |
| MADRID FTPYME I, FTA                   | 376.464                          | 852       | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 100,00     | 25,96    | 0,00                    |
| MADRID FTPYME II, FTA                  | 321.237                          | 762       | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 100,00     | 4,59     | 0,00                    |
| MADRID ICO-FTVPO I, FTA                | 158.249                          | 110       | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 100,00     | 8,08     | 0,00                    |
| MADRID RESIDENCIAL I, FTA              | 387.871                          | 248       | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 12,70    | 0,00                    |

| FONDO                           | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |           |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |           |                  |           |  | MEJORAS    |          |                         |
|---------------------------------|----------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|-------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|------------|----------|-------------------------|
|                                 | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1) | % FR (2) | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|                                 | PRINCIPAL                        | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  |            |          |                         |
| MADRID RESIDENCIAL II, FTA      | 382.718                          | 245       | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 10,97    | 0,00                    |
| MADRID RMBS I, FTA              | 769.306                          | 292       | 0                | 0         | 0  | 200.000                       | 143       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,48     | 0,00                    |
| MADRID RMBS II, FTA             | 404.614                          | 149       | 0                | 0         | 0  | 450.000                       | 245       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,14     | 0,00                    |
| MADRID RMBS III FTA             | 858.371                          | 363       | 0                | 0         | 0  | 767.000                       | 500       | 0                | 12.331    | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| MADRID RMBS IV, FTA             | 236.813                          | 126       | 0                | 0         | 0  | 1.048.800                     | 717       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 7,64     | 0,00                    |
| MBS BANCAJA 1 FTA               | 86.879                           | 37        | 0                | 0         | 0  | 25.109                        | 21        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,79     | 0,00                    |
| MBS BANCAJA 2, FTA              | 201.522                          | 68        | 0                | 0         | 0  | 54.800                        | 83        | 0                | 261       | 0  | 0,00       | 3,67     | 0,00                    |
| MBS BANCAJA 3, FTA              | 302.196                          | 13        | 0                | 0         | 0  | 42.000                        | 9         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,95     | 0,00                    |
| MBS BANCAJA 4, FTA              | 597.557                          | 411       | 0                | 0         | 0  | 391.000                       | 480       | 0                | 414       | 0  | 0,00       | 2,21     | 0,00                    |
| MBS BANCAJA 6, FTA              | 657.257                          | 321       | 0                | 0         | 0  | 96.000                        | 136       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 9,60     | 0,00                    |
| MBS BANCAJA 7, FTA              | 379.889                          | 202       | 0                | 0         | 0  | 402.500                       | 388       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,62     | 0,00                    |
| MBS BANCAJA 8, FTA              | 231.841                          | 16        | 0                | 0         | 0  | 175.500                       | 21        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,50     | 0,00                    |
| MBSCAT 1, FTA                   | 485.749                          | 484       | 0                | 0         | 0  | 86.600                        | 184       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,00     | 0,00                    |
| MBSCAT 2, FTA                   | 113.571                          | 16        | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,90     | 0,00                    |
| PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA       | 10.160.000                       | 238.711   | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| PYME BANCAJA 5, FTA             | 29.150                           | 12        | 0                | 0         | 0  | 115.600                       | 224       | 0                | 5.531     | -10.488  | 0,00       | 5,51     | 0,00                    |
| PYME BANCAJA 7, FTA             | 77.525                           | 8         | 0                | 0         | 0  | 262.400                       | 65        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 49,11    | 0,00                    |
| PYME VALENCIA 1, FTA            | 81.391                           | 8         | 0                | 0         | 0  | 110.500                       | 40        | 0                | 3.184     | -7.469   | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| PYME VALENCIA 2, FTA            | 86.008                           | 6         | 0                | 0         | 0  | 92.500                        | 13        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 47,19    | 0,00                    |
| PYMECAT 2 FTPYME, FTA           | 68.963                           | 13        | 0                | 0         | 0  | 72.500                        | 27        | 0                | 0         | 0  | 21,64      | 7,42     | 0,00                    |
| PYMECAT 3 FTPYME, FTA           | 85.874                           | 46        | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 10,13    | 0,00                    |
| PYMES BANESTO 2, FTA            | 169.957                          | 24        | 0                | 0         | 0  | 58.300                        | 15        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| RURAL CEDULA I, FTA             | 1.000.000                        | 32.219    | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA | 380.145                          | 300       | 0                | 0         | 0  | 69.900                        | 225       | 0                | 146       | 0  | 0,00       | 2,92     | 0,00                    |
| RURAL HIPOTECARIO II FTH        | 10.505                           | 6         | 0                | 0         | 0  | 13.000                        | 13        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 10,51    | 0,00                    |
| RURAL HIPOTECARIO III FTH       | 40.304                           | 8         | 0                | 0         | 0  | 12.700                        | 5         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 6,26     | 0,00                    |

| FONDO                                     | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |           |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |           |                  |           |  | MEJORAS    |          |                         |
|---|----------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|-------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|------------|----------|-------------------------|
|   | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1) | % FR (2) | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|   | PRINCIPAL                        | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  |            |          |                         |
| RURAL HIPOTECARIO IV FTH                  | 83.016                           | 49        | 0                | 0         | 0  | 21.300                        | 22        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,69     | 0,00                    |
| RURAL HIPOTECARIO IX, FTA                 | 589.619                          | 233       | 0                | 0         | 0  | 293.300                       | 240       | 0                | 2.659     | 0  | 0,00       | 0,98     | 0,00                    |
| RURAL HIPOTECARIO V FTA                   | 170.506                          | 31        | 0                | 0         | 0  | 15.028                        | 6         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 4,62     | 0,00                    |
| RURAL HIPOTECARIO VI, FTA                 | 286.032                          | 235       | 0                | 0         | 0  | 27.207                        | 45        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,40     | 0,00                    |
| RURAL HIPOTECARIO VII, FTA                | 379.638                          | 51        | 0                | 0         | 0  | 35.246                        | 8         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,34     | 0,00                    |
| RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA               | 588.727                          | 411       | 0                | 0         | 0  | 61.800                        | 184       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,86     | 0,00                    |
| RURAL HIPOTECARIO X, FTA                  | 1.190.047                        | 583       | 0                | 0         | 0  | 91.200                        | 74        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,15     | 0,00                    |
| RURAL HIPOTECARIO XI, FTA                 | 1.532.674                        | 103       | 0                | 0         | 0  | 86.900                        | 10        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 4,19     | 0,00                    |
| RURAL HIPOTECARIO XII, FTA                | 693.810                          | 75        | 0                | 0         | 0  | 47.800                        | 8         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 5,58     | 0,00                    |
| RURALPYME 1 FTPYME FTA                    | 2.219                            | 0         | 0                | 0         | 0  | 20.230                        | 9         | 0                | 0         | 0  | 9,88       | 38,43    | 0,00                    |
| RURALPYME 2 FTPYME FTA                    | 25.386                           | 17        | 0                | 0         | 0  | 130.050                       | 275       | 0                | 3.845     | 0  | 34,55      | 18,29    | 0,00                    |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN 09-1, FTA        | 73.650                           | 73        | 0                | 0         | 0  | 172.900                       | 527       | 0                | 370       | -4.341   | 0,00       | 24,22    | 0,00                    |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2010-1, FTA | 162.589                          | 168       | 0                | 0         | 0  | 195.000                       | 278       | 0                | 0         | -1.343   | 0,00       | 35,41    | 0,00                    |
| SANTANDER HIPOTECARIO I, FTA              | 447.195                          | 379       | 0                | 0         | 0  | 156.600                       | 273       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,17     | 0,00                    |
| SOL-LION, FTA                             | 3.085.346                        | 1.759     | 0                | 0         | 0  | 180.000                       | 231       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,55     | 0,00                    |
| TDA 11, FTH                               | 29.020                           | 26        | 0                | 0         | 0  | 26.400                        | 34        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 12,46    | 0,00                    |
| TDA 12, FTH                               | 31.372                           | 28        | 0                | 0         | 0  | 20.600                        | 27        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 10,38    | 0,00                    |
| TDA 13 - MIXTO, FTA                       | 35.181                           | 31        | 0                | 0         | 0  | 17.400                        | 22        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| TDA 14 - MIXTO, FTA                       | 75.668                           | 67        | 0                | 0         | 0  | 26.800                        | 42        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| TDA 15 - MIXTO, FTA                       | 83.084                           | 6         | 0                | 0         | 0  | 21.200                        | 4         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| TDA 16 - MIXTO, FTA                       | 83.093                           | 7         | 0                | 0         | 0  | 24.200                        | 3         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| TDA 17 - MIXTO, FTA                       | 69.346                           | 5         | 0                | 0         | 0  | 16.200                        | 2         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| TDA 18 - MIXTO, FTA                       | 86.548                           | 7         | 0                | 0         | 0  | 23.700                        | 4         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| TDA 19 - MIXTO, FTA                       | 153.903                          | 11        | 0                | 0         | 0  | 21.776                        | 8         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 6,62     | 0,00                    |
| TDA 20 - MIXTO, FTA                       | 116.429                          | 81        | 0                | 0         | 0  | 18.300                        | 23        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |

| FONDO                   | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |           |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |           |                  |           |  | MEJORAS    |          |                         |
|-------------------------|----------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|-------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|------------|----------|-------------------------|
|                         | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1) | % FR (2) | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|                         | PRINCIPAL                        | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  |            |          |                         |
| TDA 22 - MIXTO, FTA     | 22.618                           | 0         | 0                | 0         | 0  | 143.300                       | 9         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| TDA 23, FTA             | 266.158                          | 14        | 0                | 0         | 0  | 22.800                        | 3         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,88     | 0,00                    |
| TDA 24, FTA             | 113.558                          | 7         | 0                | 0         | 0  | 95.658                        | 9         | 0                | 604       | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| TDA 25, FTA             | 136.750                          | 9         | 0                | 0         | 0  | 14.700                        | 3         | 0                | 926       | -4.306   | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| TDA 26 - MIXTO, FTA     | 342.619                          | 248       | 16               | 470       | 0  | 27.246                        | 28        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| TDA 27, FTA             | 272.365                          | 8         | 0                | 0         | 0  | 233.100                       | 10        | 0                | 1.594     | 0  | 0,00       | 0,00     | 1,01                    |
| TDA 28, FTA             | 295.123                          | 207       | 0                | 0         | -8.138   | 37.350                        | 94        | 0                | 2.719     | -19.278  | 0,00       | 0,00     | 0,43                    |
| TDA 29, FTA             | 421.306                          | 150       | 0                | 0         | 0  | 31.600                        | 37        | 0                | 454       | 0  | 0,00       | 0,29     | 0,00                    |
| TDA 30, FTA             | 243.209                          | 10        | 0                | 0         | 0  | 24.000                        | 5         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,14     | 0,00                    |
| TDA 31, FTA             | 157.151                          | 75        | 0                | 0         | 0  | 19.500                        | 23        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,56     | 0,00                    |
| TDA CAJAMAR 2, FTA      | 145.202                          | 5         | 0                | 0         | 0  | 230.090                       | 12        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,97     | 0,56                    |
| TDA CAM 1, FTA          | 197.983                          | 17        | 0                | 0         | 0  | 26.500                        | 4         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 4,56     | 0,00                    |
| TDA CAM 10, FTA         | 437.156                          | 28        | 0                | 4.389     | 0  | 291.314                       | 21        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,76     | 0,00                    |
| TDA CAM 11, FTA         | 402.279                          | 20        | 0                | 0         | 0  | 825.594                       | 78        | 0                | 4.946     | 0  | 0,00       | 5,08     | 0,00                    |
| TDA CAM 12, FTA         | 521.550                          | 25        | 0                | 0         | 0  | 931.000                       | 87        | 0                | 5.243     | 0  | 0,00       | 4,26     | 0,00                    |
| TDA CAM 2, FTA          | 231.190                          | 181       | 0                | 0         | 0  | 27.200                        | 45        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,32     | 0,00                    |
| TDA CAM 3, FTA          | 259.977                          | 206       | 0                | 0         | 0  | 28.800                        | 48        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,19     | 0,00                    |
| TDA CAM 4, FTA          | 630.351                          | 19        | 0                | 0         | 0  | 48.000                        | 2         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,76     | 0,00                    |
| TDA CAM 5, FTA          | 862.679                          | 509       | 0                | 0         | 0  | 56.000                        | 57        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,81     | 0,00                    |
| TDA CAM 6, FTA          | 560.794                          | 327       | 0                | 0         | 0  | 50.000                        | 41        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,28     | 0,00                    |
| TDA CAM 7, FTA          | 815.059                          | 264       | 0                | 0         | 0  | 92.700                        | 44        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,43     | 0,00                    |
| TDA CAM 8, FTA          | 867.176                          | 312       | 0                | 2.450     | 0  | 64.600                        | 33        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,53     | 0,00                    |
| TDA CAM 9, FTA          | 604.850                          | 492       | 0                | 2.943     | 0  | 248.853                       | 218       | 0                | 84        | 0  | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| TDA CORPORATIVOS I, FTA | 144.651                          | 222       | 0                | 0         | 0  | 167.450                       | 579       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 117,10   | 0,00                    |
| TDA EMPRESAS 1, FTA     | 52.124                           | 7         | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 17,74    | 0,00                    |
| TDA EMPRESAS 2, FTA     | 20.785                           | 18        | 0                | 0         | 0  | 43.700                        | 130       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 94,66    | 0,00                    |



| FONDO                                   | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |           |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |           |                  |           |  | MEJORAS    |          |                         |
|---|----------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|-------------------------------|-----------|------------------|-----------|--|------------|----------|-------------------------|
|   | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |           | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1) | % FR (2) | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|   | PRINCIPAL                        | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES | PRINCIPAL        | INTERESES |  |            |          |                         |
| TDA FTPYME PASTOR 9, FTA                | 139.558                          | 218       | 0                | 0         | 0  | 127.500                       | 361       | 0                | 0         | 0  | 52,26      | 26,91    | 0,00                    |
| TDA IBERCAJA 1, FTA                     | 158.879                          | 129       | 0                | 0         | 0  | 13.163                        | 34        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,53     | 0,00                    |
| TDA IBERCAJA 2, FTA                     | 379.133                          | 217       | 0                | 0         | 0  | 31.382                        | 65        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,14     | 0,00                    |
| TDA IBERCAJA 3, FTA                     | 452.445                          | 12        | 0                | 0         | 0  | 46.894                        | 3         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,41     | 0,00                    |
| TDA IBERCAJA 4, FTA                     | 688.282                          | 254       | 0                | 0         | 0  | 60.200                        | 39        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 1,45     | 0,00                    |
| TDA IBERCAJA 5, FTA                     | 669.046                          | 211       | 0                | 0         | 0  | 55.000                        | 59        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 0,99     | 0,00                    |
| TDA IBERCAJA 6, FTA                     | 977.092                          | 465       | 0                | 0         | 0  | 81.000                        | 150       | 0                | 913       | 0  | 0,00       | 3,28     | 0,00                    |
| TDA IBERCAJA 7, FTA                     | 1.586.479                        | 756       | 0                | 0         | 0  | 170.000                       | 240       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 4,21     | 0,00                    |
| TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH             | 315.384                          | 166       | 0                | 0         | 0  | 37.700                        | 135       | 0                | 53        | 0  | 89,32      | 12,17    | 0,00                    |
| TDA LICO LEASING III, FTA               | 78.000                           | 433       | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,32     | 0,00                    |
| TDA PASTOR 1, FTA                       | 34.049                           | 1         | 0                | 0         | 0  | 61.100                        | 3         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,54     | 0,00                    |
| TDA PASTOR CONSUMO 1, FTA               | 20.509                           | 12        | 0                | 0         | 0  | 17.900                        | 20        | 0                | 0         | -8.140   | 0,00       | 0,00     | 0,00                    |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA           | 27.894                           | 13        | 0                | 0         | 0  | 30.835                        | 43        | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 25,77    | 0,00                    |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA           | 51.667                           | 2         | 0                | 0         | 0  | 77.274                        | 8         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 30,26    | 0,00                    |
| TDA TARRAGONA 1, FTA                    | 233.848                          | 15        | 0                | 0         | 0  | 37.700                        | 10        | 0                | 2.511     | 0  | 0,00       | 0,88     | 0,00                    |
| UNICAJA ANDALUCIA FTVIVIENDA TDA 1, FTA | 152.084                          | 133       | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 100,00     | 10,41    | 0,00                    |
| UNICAJA AYT EMPRESAS I, FTA             | 85.321                           | 101       | 0                | 0         | 0  | 36.300                        | 112       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 20,53    | 0,00                    |
| UNICAJA TDA VPO, FTA                    | 151.875                          | 146       | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 6,40     | 0,00                    |
| VAL BANCAJA 1, FTA                      | 46.409                           | 24        | 0                | 0         | 0  | 204.181                       | 113       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 11,57    | 0,00                    |
| VALENCIA HIPOTECARIO 1, FTA             | 121.225                          | 45        | 0                | 0         | 0  | 9.829                         | 9         | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 3,67     | 0,00                    |
| VALENCIA HIPOTECARIO 2, FTH             | 368.430                          | 243       | 0                | 0         | 0  | 40.500                        | 105       | 0                | 0         | 0  | 0,00       | 2,53     | 0,00                    |
| VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA             | 441.252                          | 33        | 0                | 0         | 0  | 40.300                        | 12        | 0                | 787       | 0  | 0,00       | 1,98     | 0,00                    |

| FONDO                          | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |                  |                  |               |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |                |                  |                |  | MEJORAS      |               |                         |
|--------------------------------|----------------------------------|------------------|------------------|---------------|--|-------------------------------|----------------|------------------|----------------|--|--------------|---------------|-------------------------|
|                                | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |                  | IMPORTE IMPAGADO |               | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |                | IMPORTE IMPAGADO |                | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1)   | % FR (2)      | % LÍNEA DE LIQUIDEZ (3) |
|                                | PRINCIPAL                        | INTERESES        | PRINCIPAL        | INTERESES     |  | PRINCIPAL                     | INTERESES      | PRINCIPAL        | INTERESES      |  |              |               |                         |
| VALENCIA HIPOTECARIO 4, FTA    | 588.016                          | 703              | 0                | 0             | 0  | 95.100                        | 373            | 0                | 6.140          | -26.289  | 0,00         | 0,00          | 0,00                    |
| VALENCIA HIPOTECARIO 5, FTA    | 349.388                          | 186              | 0                | 0             | 0  | 32.000                        | 36             | 0                | 0              | 0  | 0,00         | 4,92          | 0,00                    |
| <b>Subtotal BONOS 2012 2</b>   | <b>267.945.352</b>               | <b>2.416.802</b> | <b>173.925</b>   | <b>20.848</b> | <b>-27.356</b>                                     | <b>51.911.225</b>             | <b>75.796</b>  | <b>0</b>         | <b>270.650</b> | <b>-1.509.940</b>                                  | <b>2,61</b>  | <b>8,41</b>   | <b>1,59</b>             |
| <b>Subtotal BONOS 2011 2</b>   | <b>348.213.759</b>               | <b>3.022.364</b> | <b>77.718</b>    | <b>16.733</b> | <b>-825</b>  | <b>63.986.133</b>             | <b>192.427</b> | <b>0</b>         | <b>277.017</b> | <b>-908.527</b>                                    | <b>2,80</b>  | <b>7,33</b>   | <b>1,55</b>             |
| <b>%Variación</b>              | <b>-23,05</b>                    | <b>-20,04</b>    | <b>123,79</b>    | <b>24,59</b>  | <b>3.215,88</b>                                    | <b>-18,87</b>                 | <b>-60,61</b>  | <b>-</b>         | <b>-2,30</b>   | <b>66,20</b>                                       | <b>-6,79</b> | <b>14,73</b>  | <b>2,58</b>             |
| <b>PAGARÉS</b>                 |                                  |                  |                  |               |  |                               |                |                  |                |  |              |               |                         |
| FTA SANTANDER 2                | 0                                | 0                | 0                | 0             | 0  | 0                             | 0              | 0                | 0              | 0  | 0,00         | 17,56         | 32,29                   |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2012 2</b> | <b>0</b>                         | <b>0</b>         | <b>0</b>         | <b>0</b>      | <b>0</b>   | <b>0</b>                      | <b>0</b>       | <b>0</b>         | <b>0</b>       | <b>0</b>   | <b>0,00</b>  | <b>17,56</b>  | <b>32,29</b>            |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2011 2</b> | <b>19.000</b>                    | <b>19</b>        | <b>0</b>         | <b>0</b>      | <b>0</b>   | <b>0</b>                      | <b>0</b>       | <b>0</b>         | <b>0</b>       | <b>0</b>   | <b>0,00</b>  | <b>5,09</b>   | <b>27,45</b>            |
| <b>%Variación</b>              | <b>-100,00</b>                   | <b>-100,00</b>   | <b>-</b>         | <b>-</b>      | <b>-</b>   | <b>-</b>                      | <b>-</b>       | <b>-</b>         | <b>-</b>       | <b>-</b>   | <b>-</b>     | <b>244,99</b> | <b>17,63</b>            |
| <b>Total 2012 2</b>            | <b>267.945.352</b>               | <b>2.416.802</b> | <b>173.925</b>   | <b>20.848</b> | <b>-27.356</b>                                     | <b>51.911.225</b>             | <b>75.796</b>  | <b>0</b>         | <b>270.650</b> | <b>-1.509.940</b>                                  | <b>2,60</b>  | <b>8,44</b>   | <b>1,71</b>             |
| <b>Total 2011 2</b>            | <b>348.232.759</b>               | <b>3.022.383</b> | <b>77.718</b>    | <b>16.733</b> | <b>-825</b>  | <b>63.986.133</b>             | <b>192.427</b> | <b>0</b>         | <b>277.017</b> | <b>-908.527</b>                                    | <b>2,78</b>  | <b>7,32</b>   | <b>1,64</b>             |
| <b>%Variación</b>              | <b>-23,06</b>                    | <b>-20,04</b>    | <b>123,79</b>    | <b>24,59</b>  | <b>3.215,88</b>                                    | <b>-18,87</b>                 | <b>-60,61</b>  | <b>-</b>         | <b>-2,30</b>   | <b>66,20</b>                                       | <b>-6,47</b> | <b>15,30</b>  | <b>4,27</b>             |

Nota: Importes en miles de euros

(1) Porcentaje que representa el importe de los avales sobre los pasivos emitidos

(2) Porcentaje que representa el importe del fondo de reserva sobre los activos titulizados

(3) Porcentaje que representa el importe disponible en la línea de liquidez sobre los activos titulizados

| FONDO                                 | TIPO  | ACTIVO              |                                | PASIVO                                   |                                 |                             |
|---------------------------------------|-------|---------------------|--------------------------------|--|---------------------------------|-----------------------------|
|                                       |       | DERECHOS DE CRÉDITO | ACTIVOS NO CORRIENTES EN VENTA | OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES | DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO | DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO) |
| AYT ADMINISTRACIONES I, FTA           | BONOS | 132.622             | 0                              | 132.622                                  | 0                               | 0                           |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES II, FTA  | BONOS | 292.056             | 0                              | 292.043                                  | 27.865                          | 0                           |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES III, FTA | BONOS | 263.102             | 0                              | 255.330                                  | 5.333                           | -26.810                     |
| AYT LICO LEASING I, FTA               | BONOS | 33.488              | 0                              | 56.318                                   | 8.001                           | -376                        |
| AYT PRESTIGE CAJAS DE AHORRO, FTA     | BONOS | 150.029             | 0                              | 150.022                                  | 21.606                          | 0                           |
| AYT.10, FINANCIACION INVERSIONES, FTA | BONOS | 300.844             | 0                              | 300.326                                  | 15.041                          | -2.494                      |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA Nº 2,FTA  | BONOS | 12.029              | 0                              | 11.760                                   | 0                               | 0                           |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA Nº 3, FTA | BONOS | 15.924              | 0                              | 16.070                                   | 0                               | 0                           |
| CAJA SAN FERNANDO CDO I, FTA          | BONOS | 43.055              | 0                              | 46.472                                   | 3.250                           | -133                        |
| CAP-TDA 2, FTA                        | BONOS | 308.802             | 0                              | 300.187                                  | 0                               | 0                           |
| EMPRESAS TDA CAM 10, FTA              | BONOS | 470.103             | 0                              | 530.858                                  | 26.320                          | 0                           |
| GC COMPASS SPAIN 2, FTA               | BONOS | 60.940              | 0                              | 49.255                                   | 0                               | 0                           |
| MORTGAGE FINANCE SPAIN, FTA           | BONOS | 217.565             | 0                              | 217.464                                  | 0                               | 0                           |
| SOFINLOC ESPAÑA TDA Nº 1, FTA         | BONOS | 28.249              | 0                              | 28.777                                   | 0                               | 0                           |
| TDA FS1, FTA                          | BONOS | 123.258             | 0                              | 120.203                                  | 0                               | -10.627                     |
| VALENCIA ACTIVOS 1, FTA               | BONOS | 769.740             | 0                              | 955.012                                  | 120.951                         | 0                           |
| <b>Subtotal BONOS 2012 2</b>          |       | <b>3.221.806</b>    | <b>0</b>                       | <b>3.462.719</b>                         | <b>228.367</b>                  | <b>-40.440</b>              |
| <b>Subtotal BONOS 2011 2</b>          |       | <b>2.990.527</b>    | <b>0</b>                       | <b>3.010.763</b>                         | <b>140.998</b>                  | <b>-51.146</b>              |
| <b>%Variación</b>                     |       | <b>7,73</b>         | <b>-</b>                       | <b>15,01</b>                             | <b>61,96</b>                    | <b>-20,93</b>               |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2012 2</b>        |       | <b>0</b>            | <b>0</b>                       | <b>0</b>                                 | <b>0</b>                        | <b>0</b>                    |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2011 2</b>        |       | <b>320.813</b>      | <b>0</b>                       | <b>352.459</b>                           | <b>67</b>                       | <b>0</b>                    |
| <b>%Variación</b>                     |       | <b>-100,00</b>      | <b>-</b>                       | <b>-100,00</b>                           | <b>-100,00</b>                  | <b>-</b>                    |
| <b>Total 2012 2</b>                   |       | <b>3.221.806</b>    | <b>0</b>                       | <b>3.462.719</b>                         | <b>228.367</b>                  | <b>-40.440</b>              |
| <b>Total 2011 2</b>                   |       | <b>3.311.340</b>    | <b>0</b>                       | <b>3.363.222</b>                         | <b>141.065</b>                  | <b>-51.146</b>              |
| <b>%Variación</b>                     |       | <b>-2,70</b>        | <b>-</b>                       | <b>2,96</b>                              | <b>61,89</b>                    | <b>-20,93</b>               |

Nota: Importes en miles de euros

Importe pendiente derechos de crédito - Fondos de titulización privados

CUADRO A.2.1

| FONDO                                 | DEUDA<br>SUBORDINADA Y<br>BONOS |                  |           |                | CONSUMO Y<br>AUTOMOCIÓN | CUENTAS A<br>COBRAR | DERECHOS<br>DE CRÉDITO |                          |                | DUDOSOS -<br>DETERIORO | INTERESES<br>DEVENGADOS +<br>AJUSTES (1) |
|---------------------------------------|---------------------------------|------------------|-----------|----------------|-------------------------|---------------------|------------------------|--------------------------|----------------|------------------------|--|
|                                       | HIPOTECARIOS                    | EMPRESAS         | TESORERÍA | AAPP           |                         |                     | FUTUROS                | BONOS DE<br>TITULIZACIÓN | OTROS          |                        |  |
| <b>BONOS</b>                          |                                 |                  |           |                |                         |                     |                        |                          |                |                        |  |
| AYT ADMINISTRACIONES I, FTA           | 0                               | 0                | 0         | 128.392        | 0                       | 0                   | 0                      | 0                        | 0              | 0                      | 4.230                                    |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES II, FTA  | 292.000                         | 0                | 0         | 0              | 0                       | 0                   | 0                      | 0                        | 0              | 0                      | 56                                       |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES III, FTA | 255.000                         | 0                | 0         | 0              | 0                       | 0                   | 0                      | 0                        | 0              | 0                      | 8.102                                    |
| AYT LICO LEASING I, FTA               | 0                               | 31.150           | 0         | 0              | 0                       | 0                   | 0                      | 0                        | 0              | 2.281                  | 57                                       |
| AYT PRESTIGE CAJAS DE AHORRO, FTA     | 150.000                         | 0                | 0         | 0              | 0                       | 0                   | 0                      | 0                        | 0              | 0                      | 29                                       |
| AYT.10, FINANCIACION INVERSIONES, FTA | 300.000                         | 0                | 0         | 0              | 0                       | 0                   | 0                      | 0                        | 0              | 0                      | 844                                      |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA Nº 2,FTA  | 0                               | 0                | 0         | 0              | 11.274                  | 0                   | 0                      | 0                        | 0              | -49                    | 804                                      |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA Nº 3, FTA | 0                               | 0                | 0         | 0              | 14.942                  | 0                   | 0                      | 0                        | 0              | 328                    | 654                                      |
| CAJA SAN FERNANDO CDO I, FTA          | 0                               | 0                | 0         | 0              | 0                       | 0                   | 0                      | 44.236                   | 0              | -1.269                 | 88                                       |
| CAP-TDA 2, FTA                        | 0                               | 0                | 0         | 0              | 0                       | 265.004             | 0                      | 0                        | 0              | 43.798                 | 0  |
| EMPRESAS TDA CAM 10, FTA              | 0                               | 427.064          | 0         | 0              | 0                       | 0                   | 0                      | 0                        | 0              | 40.656                 | 2.383                                    |
| GC COMPASS SPAIN 2, FTA               | 0                               | 0                | 0         | 0              | 0                       | 60.462              | 0                      | 0                        | 0              | 478                    | 0  |
| MORTGAGE FINANCE SPAIN, FTA           | 217.212                         | 0                | 0         | 0              | 0                       | 0                   | 0                      | 0                        | 0              | 0                      | 353                                      |
| SOFINLOC ESPAÑA TDA Nº 1, FTA         | 0                               | 0                | 0         | 0              | 26.828                  | 0                   | 0                      | 0                        | 0              | 1.064                  | 357                                      |
| TDA FS1, FTA                          | 0                               | 0                | 0         | 0              | 0                       | 0                   | 0                      | 0                        | 120.188        | 0                      | 3.070                                    |
| VALENCIA ACTIVOS 1, FTA               | 0                               | 744.472          | 0         | 0              | 0                       | 0                   | 0                      | 0                        | 0              | 19.632                 | 5.636                                    |
| <b>Subtotal BONOS 2012 2</b>          | <b>1.214.212</b>                | <b>1.202.686</b> | <b>0</b>  | <b>128.392</b> | <b>53.044</b>           | <b>325.466</b>      | <b>0</b>               | <b>44.236</b>            | <b>120.188</b> | <b>106.919</b>         | <b>26.663</b>                            |
| De los cuales cédulas                 | 997.000                         |                  |           | 0              |                         |                     |                        |                          |                |                        |  |
| <b>Subtotal BONOS 2011 2</b>          | <b>1.216.369</b>                | <b>792.340</b>   | <b>0</b>  | <b>138.268</b> | <b>91.154</b>           | <b>316.667</b>      | <b>10.746</b>          | <b>60.981</b>            | <b>156.634</b> | <b>182.792</b>         | <b>24.576</b>                            |
| <b>%Variación</b>                     | <b>-0,18</b>                    | <b>51,79</b>     | <b>-</b>  | <b>-7,14</b>   | <b>-41,81</b>           | <b>2,78</b>         | <b>-100,00</b>         | <b>-27,46</b>            | <b>-23,27</b>  | <b>-41,51</b>          | <b>8,49</b>                              |
| <b>PAGARÉS</b>                        |                                 |                  |           |                |                         |                     |                        |                          |                |                        |  |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2012 2</b>        | <b>0</b>                        | <b>0</b>         | <b>0</b>  | <b>0</b>       | <b>0</b>                | <b>0</b>            | <b>0</b>               | <b>0</b>                 | <b>0</b>       | <b>0,00</b>            | <b>0,00</b>                              |
| De los cuales cédulas                 |                                 |                  |           |                |                         |                     |                        |                          |                |                        |  |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2011 2</b>        | <b>0</b>                        | <b>0</b>         | <b>0</b>  | <b>0</b>       | <b>312.939</b>          | <b>0</b>            | <b>0</b>               | <b>0</b>                 | <b>0</b>       | <b>7.874</b>           | <b>0</b>                                 |
| <b>%Variación</b>                     | <b>-</b>                        | <b>-</b>         | <b>-</b>  | <b>-</b>       | <b>-100,00</b>          | <b>-</b>            | <b>-</b>               | <b>-</b>                 | <b>-</b>       | <b>-100,00</b>         | <b>-</b>                                 |
| <b>Total 2012 2</b>                   | <b>1.214.212</b>                | <b>1.202.686</b> | <b>0</b>  | <b>128.392</b> | <b>53.044</b>           | <b>325.466</b>      | <b>0</b>               | <b>44.236</b>            | <b>120.188</b> | <b>106.919</b>         | <b>26.663</b>                            |
| De los cuales cédulas                 | 997.000                         |                  |           | 0              |                         |                     |                        |                          |                |                        |  |
| <b>Total 2011 2</b>                   | <b>1.216.369</b>                | <b>792.340</b>   | <b>0</b>  | <b>138.268</b> | <b>404.093</b>          | <b>316.667</b>      | <b>10.746</b>          | <b>60.981</b>            | <b>156.634</b> | <b>190.666</b>         | <b>24.576</b>                            |
| <b>%Variación</b>                     | <b>-0,18</b>                    | <b>51,79</b>     | <b>-</b>  | <b>-7,14</b>   | <b>-86,87</b>           | <b>2,78</b>         | <b>-100,00</b>         | <b>-27,46</b>            | <b>-23,27</b>  | <b>-43,92</b>          | <b>8,49</b>                              |

Nota: Importes en miles de euros

**Información sobre los encabezados**

(1) Incluye intereses vencidos e impagados

Información derechos de crédito - Fondos de titulización privados

CUADRO A.2.2

| FONDO                                 | TIPO DE FONDO | TIPO DE ACTIVOS                         | TAA (1)     | DUDOSOS (3) | FALLIDOS (4) | RECUPERACIÓN FALLIDOS (5) | VIDA RESIDUAL (6) | ANTIGÜEDAD (7) |              |
|---------------------------------------|---------------|---|-------------|-------------|--------------|---------------------------|-------------------|----------------|--------------|
| AYT ADMINISTRACIONES I, FTA           | BONOS         | CRÉDITOS AAPP                           | 7,14        | 0,00        | 0,00         | 0,00                      | 12,30             | 6,53           | 100,00       |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES II, FTA  | BONOS         | CÉDULAS HIPOTECARIAS                    | 0,00        | 0,00        | 0,00         | 0,00                      | 2,90              | 9,07           | 100,00       |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES III, FTA | BONOS         | CÉDULAS HIPOTECARIAS                    | 0,00        | 0,00        | 0,00         | 0,00                      | 2,10              | 6,89           | 100,00       |
| AYT LICO LEASING I, FTA               | BONOS         | ARRENDAMIENTO FINANCIERO                | 11,93       | 21,78       | 0,00         | 0,00                      | 2,56              | 5,97           | 13,55        |
| AYT PRESTIGE CAJAS DE AHORRO, FTA     | BONOS         | CÉDULAS HIPOTECARIAS                    | 0,00        | 0,00        | 0,00         | 0,00                      | 2,20              | 9,81           | 100,00       |
| AYT.10, FINANCIACION INVERSIONES, FTA | BONOS         | CÉDULAS HIPOTECARIAS                    | 0,00        | 0,00        | 0,00         | 0,00                      | 1,70              | 10,31          | 93,67        |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA N° 2,FTA  | BONOS         | PRÉSTAMOS AUTOMOCIÓN                    | 2,05        | 71,31       | 0,00         | 0,00                      | 0,84              | 5,96           | 0,00         |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA N° 3, FTA | BONOS         | PRÉSTAMOS AUTOMOCIÓN                    | 2,65        | 59,32       | 0,00         | 0,00                      | 1,23              | 5,59           | 0,00         |
| CAJA SAN FERNANDO CDO I, FTA          | BONOS         | BONOS DE TITULIZACIÓN                   | 0,13        | 0,00        | 0,00         | 0,00                      | 14,46             | 10,09          | 0,00         |
| CAP-TDA 2, FTA                        | BONOS         | CUENTAS A COBRAR                        | 0,00        | 10,40       | 0,00         | 0,00                      | 0,07              | 0,26           | 18,32        |
| EMPRESAS TDA CAM 10, FTA              | BONOS         | PRÉSTAMOS A EMPRESAS                    | 4,77        | 14,90       | 0,00         | 0,00                      | 6,90              | 3,59           | 9,31         |
| GC COMPASS SPAIN 2, FTA               | BONOS         | CUENTAS A COBRAR                        | 0,00        | 0,78        | 0,15         | 0,44                      | 0,07              | 0,15           | 2,82         |
| MORTGAGE FINANCE SPAIN, FTA           | BONOS         | CERTIFICADOS DE TRANSMISIÓN HIPOTECARIA | 0,98        | 0,00        | 0,00         | 0,00                      | 0,34              | 6,66           | 0,00         |
| SOFINLOC ESPAÑA TDA N° 1, FTA         | BONOS         | PRÉSTAMOS AUTOMOCIÓN                    | 2,85        | 23,01       | 0,00         | 0,00                      | 4,32              | 5,29           | 0,00         |
| TDA FS1, FTA                          | BONOS         | OTROS                                   | 0,00        | 0,00        | 0,00         | 0,00                      | 2,58              | 4,88           | 0,00         |
| VALENCIA ACTIVOS 1, FTA               | BONOS         | PRÉSTAMOS A EMPRESAS                    | 19,19       | 0,00        | 0,00         | 0,00                      | 3,77              | 3,83           | 49,86        |
| <b>Medias</b>                         |               |   | <b>5,81</b> | <b>4,17</b> | <b>0,00</b>  | <b>0,01</b>               | <b>3,51</b>       | <b>5,47</b>    | <b>49,97</b> |

Nota: Importes en miles de euros

**Información sobre los encabezados**

(1) Tasa de amortización anticipada

(3) Tasa de dudosos: cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos y el principal pendiente del total activos

(4) Tasa de fallidos: cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en balance más el principal de los activos clasificados como fallidos

(5) Tasa de recuperación de fallidos: cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de los fallidos al cierre del mismo periodo del año anterior.

(6) Vida residual media ponderada valorada en años

(7) Antigüedad media ponderada valorada en años

(8) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

Información obligaciones y otros valores negociables - Fondos de titulización privados

CUADRO A.2.3

| FONDO                                 | TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO |               |                  |           |  | TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO |              |                  |              |  | MEJORAS     |               |                         |
|---------------------------------------|----------------------------------|---------------|------------------|-----------|--|-------------------------------|--------------|------------------|--------------|--|-------------|---------------|-------------------------|
|                                       | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO     |               | IMPORTE IMPAGADO |           | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO  |              | IMPORTE IMPAGADO |              | TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS | % AVAL (1)  | % FR (2)      | % LÍNEA DE LIQUEDEZ (3) |
|                                       | PRINCIPAL                        | INTERESES     | PRINCIPAL        | INTERESES |  | PRINCIPAL                     | INTERESES    | PRINCIPAL        | INTERESES    |  |             |               |                         |
| <b>BONOS</b>                          |                                  |               |                  |           |  |                               |              |                  |              |  |             |               |                         |
| AYT ADMINISTRACIONES I, FTA           | 0                                | 0             | 0                | 0         | 0  | 128.391                       | 4.229        | 0                | 0            | 0  | 0,00        | 0,00          | 0,00                    |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES II, FTA  | 292.000                          | 43            | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0            | 0                | 0            | 0  | 0,00        | 0,00          | 0,00                    |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES III, FTA | 255.000                          | 330           | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0            | 0                | 0            | 0  | 0,00        | 0,00          | 0,00                    |
| AYT LICO LEASING I, FTA               | 25.000                           | 3             | 0                | 0         | 0  | 31.300                        | 14           | 0                | 0            | 0  | 0,00        | 29,68         | 179,17                  |
| AYT PRESTIGE CAJAS DE AHORRO, FTA     | 150.000                          | 22            | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0            | 0                | 0            | 0  | 0,00        | 7,92          | 0,00                    |
| AYT.10, FINANCIACION INVERSIONES, FTA | 300.000                          | 325           | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0            | 0                | 0            | 0  | 0,00        | 4,99          | 0,00                    |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA Nº 2,FTA  | 15.474                           | 0             | 0                | 0         | -3.714   | 0                             | 0            | 0                | 0            | 0  | 0,00        | 0,00          | 0,00                    |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA Nº 3, FTA | 17.339                           | 0             | 0                | 0         | -1.269   | 0                             | 0            | 0                | 0            | 0  | 0,00        | 0,00          | 0,00                    |
| CAJA SAN FERNANDO CDO I, FTA          | 21.141                           | 94            | 0                | 0         | 0  | 45.697                        | 255          | 0                | 488          | -21.205  | 0,00        | 0,00          | 0,00                    |
| CAP-TDA 2, FTA                        | 300.000                          | 187           | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0            | 0                | 0            | 0  | 0,00        | 0,00          | 0,00                    |
| EMPRESAS TDA CAM 10, FTA              | 455.281                          | 482           | 0                | 0         | 0  | 75.000                        | 94           | 0                | 0            | 0  | 0,00        | 11,97         | 0,00                    |
| GC COMPASS SPAIN 2, FTA               | 49.255                           | 20            | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0            | 0                | 0            | 0  | 0,00        | 19,17         | 0,00                    |
| MORTGAGE FINANCE SPAIN, FTA           | 217.212                          | 252           | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0            | 0                | 0            | 0  | 0,00        | 0,00          | 0,00                    |
| SOFINLOC ESPAÑA TDA Nº 1, FTA         | 29.169                           | 0             | 0                | 0         | -392   | 0                             | 0            | 0                | 0            | 0  | 0,00        | 0,00          | 0,00                    |
| TDA FS1, FTA                          | 120.188                          | 15            | 0                | 0         | 0  | 0                             | 0            | 0                | 0            | 0  | 0,00        | 0,23          | 0,00                    |
| VALENCIA ACTIVOS 1, FTA               | 625.045                          | 1.001         | 0                | 0         | 0  | 328.300                       | 701          | 0                | 0            | 0  | 0,00        | 0,00          | 0,00                    |
| <b>Subtotal BONOS 2012 2</b>          | <b>2.872.104</b>                 | <b>2.774</b>  | <b>0</b>         | <b>0</b>  | <b>-5.375</b>                                      | <b>608.688</b>                | <b>5.293</b> | <b>0</b>         | <b>488</b>   | <b>-21.205</b>                                     | <b>0,00</b> | <b>3,26</b>   | <b>1,86</b>             |
| <b>Subtotal BONOS 2011 2</b>          | <b>2.671.083</b>                 | <b>6.644</b>  | <b>0</b>         | <b>0</b>  | <b>-36.753</b>                                     | <b>381.757</b>                | <b>5.301</b> | <b>0</b>         | <b>365</b>   | <b>-17.617</b>                                     | <b>0,00</b> | <b>4,57</b>   | <b>2,18</b>             |
| <b>%Variación</b>                     | <b>7,53</b>                      | <b>-58,25</b> | <b>-</b>         | <b>-</b>  | <b>-85,38</b>                                      | <b>59,44</b>                  | <b>-0,15</b> | <b>-</b>         | <b>33,70</b> | <b>20,37</b>                                       | <b>-</b>    | <b>-28,67</b> | <b>-14,68</b>           |
| <b>PAGARÉS</b>                        |                                  |               |                  |           |  |                               |              |                  |              |  |             |               |                         |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2012 2</b>        | <b>0</b>                         | <b>0</b>      | <b>0</b>         | <b>0</b>  | <b>0</b>   | <b>0</b>                      | <b>0</b>     | <b>0</b>         | <b>0</b>     | <b>0</b>   | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>   | <b>0,00</b>             |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2011 2</b>        | <b>344.585</b>                   | <b>0</b>      | <b>0</b>         | <b>0</b>  | <b>0</b>   | <b>0</b>                      | <b>0</b>     | <b>0</b>         | <b>0</b>     | <b>0</b>   | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>   | <b>0,00</b>             |
| <b>%Variación</b>                     | <b>-100,00</b>                   | <b>-</b>      | <b>-</b>         | <b>-</b>  | <b>-</b>   | <b>-</b>                      | <b>-</b>     | <b>-</b>         | <b>-</b>     | <b>-</b>   | <b>-</b>    | <b>-</b>      | <b>-</b>                |
| <b>Total 2012 2</b>                   | <b>2.872.104</b>                 | <b>2.774</b>  | <b>0</b>         | <b>0</b>  | <b>-5.375</b>                                      | <b>608.688</b>                | <b>5.293</b> | <b>0</b>         | <b>488</b>   | <b>-21.205</b>                                     | <b>0,00</b> | <b>3,26</b>   | <b>1,86</b>             |
| <b>Total 2011 2</b>                   | <b>3.015.668</b>                 | <b>6.644</b>  | <b>0</b>         | <b>0</b>  | <b>-36.753</b>                                     | <b>381.757</b>                | <b>5.301</b> | <b>0</b>         | <b>365</b>   | <b>-17.617</b>                                     | <b>0,00</b> | <b>4,13</b>   | <b>1,97</b>             |
| <b>%Variación</b>                     | <b>-4,76</b>                     | <b>-58,25</b> | <b>-</b>         | <b>-</b>  | <b>-85,38</b>                                      | <b>59,44</b>                  | <b>-0,15</b> | <b>-</b>         | <b>33,70</b> | <b>20,37</b>                                       | <b>-</b>    | <b>-21,07</b> | <b>-5,58</b>            |

Nota: Importes en miles de euros

(1) Porcentaje que representa el importe de los avales sobre los pasivos emitidos

(2) Porcentaje que representa el importe del fondo de reserva sobre los activos titulizados

(3) Porcentaje que representa el importe disponible en la línea de liquidez sobre los activos titulizados

| FONDO                                   | GASTOS DE EXPLOTACIÓN |            |         |            |                  |         | DETERIORO RTDO | ACTIVOS NC EN VTA (5) |
|---|-----------------------|------------|---------|------------|------------------|---------|----------------|-----------------------|
|   | MI (1)                | INT EC (2) | IMPORTE | % / TA (3) | % COMISIONES (4) |         |                |                       |
| <b>BONOS</b>                            |                       |            |         |            |                  |         |                |                       |
| AUTO ABS 2012-3, FTA                    | 4.798                 | -118       | -4.673  | -0,55      | -0,54            | -6      | 0              |                       |
| AYT ANDALUCIA FTEMPRESA CAJAMAR, FTA    | 493                   | -220       | -77     | -0,04      | -0,02            | -3.997  | 0              |                       |
| AYT CAIXA GALICIA EMPRESAS I, FTA       | -1.527                | -76        | -250    | -0,09      | -0,06            | 9       | 0              |                       |
| AYT CAIXA SABADELL HIPOTECARIO I, FTA   | 542                   | -199       | -118    | -0,05      | -0,03            | -5.853  | 0              |                       |
| AYT CAIXANOVA FTPYME I, FTA             | -113                  | -299       | -29     | -0,04      | -0,02            | -1.764  | 0              |                       |
| AYT CAIXANOVA HIPOTECARIO I, FTA        | 46                    | -3         | -907    | -0,49      | -0,44            | 1.740   | 0              |                       |
| AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA              | 6.698                 | -150       | -6.902  | -0,73      | -0,73            | 0       | 0              |                       |
| AYT CAJA MURCIA HIPOTECARIO I, FTA      | 442                   | -13        | -437    | -0,34      | -0,33            | 1       | 0              |                       |
| AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA      | -71                   | -78        | -48     | -0,02      | -0,02            | -468    | 0              |                       |
| AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FTA      | 563                   | -13        | -560    | -0,38      | -0,37            | 0       | 0              |                       |
| AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA            | 1.867                 | -8.759     | -1.861  | 0,00       | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| AYT CEDULAS CAJAS IV, FTA               | 136                   | -933       | 1       | 0,00       | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| AYT CEDULAS CAJAS IX, FTA               | 73                    | -477       | -78     | 0,00       | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| AYT CEDULAS CAJAS V, FTA                | 109                   | -869       | -4      | 0,00       | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| AYT CEDULAS CAJAS VI, FTA               | 89                    | -568       | -4      | 0,00       | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| AYT CEDULAS CAJAS VIII, FTA             | 132                   | -996       | -4      | 0,00       | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| AYT CEDULAS CAJAS X, FTA                | 125                   | -602       | -119    | 0,00       | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FTA    | -1.183                | -2.276     | -279    | -0,05      | -0,02            | -4.325  | 32             |                       |
| AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA | 3.196                 | -2.661     | -4.708  | -0,10      | -0,04            | -16.855 | 23             |                       |
| AYT DEUDA SUBORDINADA I, FTA            | 888                   | 0          | -703    | -0,21      | -0,18            | -17.500 | 0              |                       |
| AYT FONDO EOLICO, FTA                   | 42                    | 0          | -42     | -0,21      | -0,21            | 0       | 0              |                       |
| AYT FTPYME II, FTA                      | 247                   | -106       | -54     | -0,06      | -0,03            | -240    | 0              |                       |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO II, FTH          | 177                   | -51        | -50     | -0,02      | -0,02            | -155    | -4             |                       |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO III, FTH         | 198                   | -53        | -58     | -0,02      | -0,02            | 35      | 0              |                       |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, FTH          | 244                   | -53        | -259    | -0,08      | -0,08            | 86      | -46            |                       |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH          | 697                   | -159       | -117    | -0,02      | -0,02            | -560    | -29            |                       |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH          | 191                   | -65        | -69     | -0,02      | -0,01            | 284     | -6             |                       |

| FONDO                                  | GASTOS DE EXPLOTACIÓN |            |         |            |                  |        | DETERIORO RTDO | ACTIVOS NC EN VTA (5) |
|--|-----------------------|------------|---------|------------|------------------|--------|----------------|-----------------------|
|  | MI (1)                | INT EC (2) | IMPORTE | % / TA (3) | % COMISIONES (4) |        |                |                       |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH        | 865                   | -85        | -138    | -0,02      | -0,02            | -506   | -29            |                       |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH       | 1.162                 | -213       | -197    | -0,02      | -0,02            | -625   | -20            |                       |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH          | 714                   | -190       | -136    | -0,02      | -0,02            | -906   | -213           |                       |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH         | 733                   | -641       | -262    | -0,03      | -0,01            | -470   | 100            |                       |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH        | -1.271                | -164       | -230    | -0,04      | -0,02            | 620    | -2             |                       |
| AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA          | 2.650                 | -2.159     | -1.954  | -0,05      | -0,05            | -4.317 | 0              |                       |
| AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA           | 1.477                 | -471       | -196    | -0,02      | -0,01            | -578   | 0              |                       |
| AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA            | 768                   | -619       | -190    | -0,01      | -0,01            | -1     | 0              |                       |
| AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA             | 1.198                 | -343       | -705    | -0,14      | -0,14            | -580   | 0              |                       |
| AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA            | 1.836                 | -307       | -928    | -0,15      | -0,15            | -920   | 0              |                       |
| AYT HIPOTECARIO III, FTH               | 907                   | -21        | -946    | -1,13      | -1,12            | 42     | 0              |                       |
| AYT HIPOTECARIO IV, FTH                | 887                   | -19        | -882    | -1,18      | -1,17            | -2     | 0              |                       |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FTA          | 746                   | -40        | -738    | -0,45      | -0,44            | -2     | 0              |                       |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA         | 845                   | -5         | -288    | -0,25      | -0,02            | -1.007 | 792            |                       |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, FTA          | 443                   | -29        | -242    | -0,15      | -0,15            | -206   | 0              |                       |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA           | 687                   | -24        | -126    | -0,04      | -0,03            | -908   | 0              |                       |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO, FTA             | 1.185                 | -104       | -434    | -0,43      | -0,35            | -252   | -88            |                       |
| AYT ICO FTVPO CAIXA GALICIA I, FTA     | 113                   | -170       | -70     | -0,05      | -0,02            | 0      | 0              |                       |
| AYT ICO-FTVPO CAJA MURCIA, FTA         | 254                   | -125       | -129    | -0,11      | -0,08            | 0      | 0              |                       |
| AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA    | 231                   | -61        | -61     | -0,05      | -0,02            | 59     | 0              |                       |
| AYT ICO-FTVPO I, FTA                   | 49                    | -164       | -118    | -0,05      | -0,02            | -318   | 0              |                       |
| AYT ICO-FTVPO III, FTA                 | 475                   | -106       | -304    | -0,15      | -0,11            | -17    | 0              |                       |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA           | 624                   | -68        | -202    | -0,04      | -0,04            | -488   | 0              |                       |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA          | 3.426                 | -187       | -129    | -0,02      | -0,01            | -8.693 | 0              |                       |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO IV, FTA          | 4.151                 | -1.248     | -217    | -0,01      | -0,01            | -8.593 | 0              |                       |
| AYT PRESTAMOS CONSUMO III, FTA         | -171                  | -82        | -33     | -0,11      | -0,07            | -168   | 0              |                       |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS II, FTA  | 22                    | -156       | -23     | -0,03      | -0,03            | -84    | 0              |                       |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS III, FTA | 130                   | -26        | -32     | -0,04      | -0,03            | -69    | 0              |                       |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS IV, FTA  | -332                  | -290       | -31     | -0,03      | -0,02            | -2.188 | 0              |                       |



| FONDO                                   | GASTOS DE EXPLOTACIÓN |            |         |            |                  |         | DETERIORO RTDO | ACTIVOS NC EN VTA (5) |
|---|-----------------------|------------|---------|------------|------------------|---------|----------------|-----------------------|
|   | MI (1)                | INT EC (2) | IMPORTE | % / TA (3) | % COMISIONES (4) |         |                |                       |
| AYT SA NOSTRA FINANCIACION I, FTA       | 259                   | -97        | -94     | -0,43      | -0,41            | -224    | 0              |                       |
| AYT UNICAJA FINANCIACION I, FTA         | 2.168                 | -685       | -119    | -0,06      | -0,02            | -1.385  | 0              |                       |
| AYT VPO II, FTA                         | 174                   | -84        | -36     | -0,03      | -0,02            | 50      | 0              |                       |
| AYT.1, FTH                              | 410                   | -29        | -173    | -0,48      | -0,47            | 0       | 0              |                       |
| AYT.11, FTH                             | 1.023                 | -30        | -870    | -0,96      | -0,94            | -128    | -2             |                       |
| AYT.2, FTH                              | 145                   | -14        | -104    | -0,57      | -0,55            | -10     | 0              |                       |
| AYT.7, PROMOCIONES INMOBILIARIAS I, FTA | 272                   | -60        | -28     | -0,08      | -0,07            | -113    | 0              |                       |
| BANCAJA - BVA VPO 1, FTA                | 746                   | -226       | -590    | -0,18      | -0,17            | 11      | 0              |                       |
| BANCAJA 10, FTA                         | 3.773                 | -45        | -195    | -0,01      | -0,01            | -217    | 0              |                       |
| BANCAJA 11, FTA                         | 2.959                 | -62        | -158    | -0,01      | -0,01            | -44     | 0              |                       |
| BANCAJA 13, FTA                         | 4.820                 | -1.753     | -275    | -0,01      | -0,01            | -2.736  | 0              |                       |
| BANCAJA 3, FTA                          | 453                   | -19        | -451    | -0,27      | -0,27            | 0       | 0              |                       |
| BANCAJA 4, FTH                          | 424                   | -29        | -412    | -0,22      | -0,22            | 0       | 0              |                       |
| BANCAJA 5, FTA                          | 551                   | -36        | -534    | -0,25      | -0,24            | 0       | 0              |                       |
| BANCAJA 6, FTA                          | 1.247                 | -149       | -1.161  | -0,24      | -0,23            | 1       | 0              |                       |
| BANCAJA 7, FTA                          | 1.507                 | -120       | -1.426  | -0,24      | -0,24            | 2       | 0              |                       |
| BANCAJA 8, FTA                          | 1.633                 | 0          | -882    | -0,13      | -0,13            | 40      | 0              |                       |
| BANCAJA 9, FTA                          | 2.106                 | -34        | -134    | -0,01      | -0,01            | -46     | 0              |                       |
| BANCAJA LEASING 1, FTA                  | 4.186                 | -1.226     | -82     | -0,01      | -0,01            | -15.773 | 0              |                       |
| BANKINTER 10, FTA                       | 722                   | 0          | -625    | -0,08      | -0,07            | -103    | -62            |                       |
| BANKINTER 11, FTH                       | 311                   | 0          | -315    | -0,07      | -0,06            | -14     | -22            |                       |
| BANKINTER 12, FTH                       | 837                   | 0          | -712    | -0,11      | -0,10            | -47     | -122           |                       |
| BANKINTER 13 FTA                        | 1.049                 | -6         | -224    | -0,02      | -0,01            | -777    | -613           |                       |
| BANKINTER 2 PYME FTA                    | 187                   | -4         | -66     | -0,03      | -0,02            | -2      | 31             |                       |
| BANKINTER 2, FTH                        | 166                   | 0          | -176    | -0,46      | -0,45            | 0       | 0              |                       |
| BANKINTER 3 FTPYME FTA                  | 64                    | -4         | -85     | -0,03      | -0,01            | -43     | -5             |                       |
| BANKINTER 3, FTH                        | 350                   | -95        | -294    | -0,11      | -0,11            | 0       | 0              |                       |
| BANKINTER 4 FTPYME, FTA                 | 351                   | -473       | -94     | -0,04      | -0,01            | 174     | -91            |                       |
| BANKINTER 4, FTH                        | 342                   | -38        | -327    | -0,13      | -0,12            | 0       | 0              |                       |

| FONDO                     | GASTOS DE EXPLOTACIÓN |            |         |            |                  |         | DETERIORO RTDO | ACTIVOS NC EN VTA (5) |
|---------------------------|-----------------------|------------|---------|------------|------------------|---------|----------------|-----------------------|
|                           | MI (1)                | INT EC (2) | IMPORTE | % / TA (3) | % COMISIONES (4) |         |                |                       |
| BANKINTER 5, FTH          | 315                   | -30        | -300    | -0,17      | -0,16            | 0       | 0              |                       |
| BANKINTER 6, FTA          | 687                   | -96        | -636    | -0,14      | -0,14            | 0       | 0              |                       |
| BANKINTER 7, FTH          | 288                   | -77        | -228    | -0,14      | -0,14            | 0       | 0              |                       |
| BANKINTER 8, FTA          | 739                   | -166       | -609    | -0,17      | -0,17            | 0       | 0              |                       |
| BANKINTER 9, FTA          | 864                   | -237       | -616    | -0,14      | -0,13            | -32     | -22            |                       |
| BBVA AUTOS 1 FTA          | 180                   | -248       | -53     | -0,17      | -0,12            | 301     | 0              |                       |
| BBVA AUTOS 2 FTA          | 1.755                 | -273       | -52     | -0,04      | -0,03            | -187    | 0              |                       |
| BBVA CONSUMO 1, FTA       | 2.480                 | -379       | -55     | -0,03      | -0,02            | 675     | -4             |                       |
| BBVA CONSUMO 2, FTA       | 3.524                 | -412       | -71     | -0,03      | -0,02            | 10      | -5             |                       |
| BBVA CONSUMO 3 FTA        | 2.651                 | -393       | -130    | -0,06      | -0,03            | 8.005   | 0              |                       |
| BBVA CONSUMO 4 FTA        | 4.153                 | -621       | -129    | -0,02      | -0,01            | -8.116  | 0              |                       |
| BBVA CONSUMO 5, FTA       | 5.776                 | -1.081     | -803    | -0,07      | -0,07            | -10.634 | 0              |                       |
| BBVA EMPRESAS 1, FTA      | 485                   | -620       | -50     | -0,02      | -0,02            | -1.021  | 0              |                       |
| BBVA EMPRESAS 2, FTA      | 2.846                 | -8.092     | -197    | -0,01      | -0,01            | 15.027  | -374           |                       |
| BBVA EMPRESAS 3, FTA      | 2.792                 | -1.328     | -171    | -0,01      | -0,01            | -7.378  | -688           |                       |
| BBVA EMPRESAS 4, FTA      | 882                   | -1.551     | -153    | -0,01      | -0,01            | 6.353   | -166           |                       |
| BBVA EMPRESAS 5, FTA      | 1.637                 | -657       | -146    | -0,02      | -0,01            | -3.006  | -215           |                       |
| BBVA EMPRESAS 6, FTA      | 2.512                 | -363       | -816    | -0,08      | -0,08            | -2.655  | 0              |                       |
| BBVA FINANZIA AUTOS 1 FTA | 1.275                 | -240       | -44     | -0,04      | -0,03            | -771    | 0              |                       |
| BBVA HIPOTECARIO 3, FTA   | 1.007                 | -271       | -753    | -0,34      | -0,33            | 0       | -27            |                       |
| BBVA LEASING 1, FTA       | 895                   | -722       | -90     | -0,02      | -0,02            | -6.210  | -7             |                       |
| BBVA RMBS 1, FTA          | 5.307                 | -666       | -548    | -0,03      | -0,01            | -1.752  | -3.678         |                       |
| BBVA RMBS 10, FTA         | 3.261                 | -485       | -2.871  | -0,17      | -0,15            | -87     | -106           |                       |
| BBVA RMBS 11, FTA         | 13.629                | -729       | -13.254 | -0,82      | -0,81            | -93     | -64            |                       |
| BBVA RMBS 2, FTA          | 10.534                | -715       | -1.090  | -0,03      | -0,01            | -1.931  | -6.961         |                       |
| BBVA RMBS 3, FTA          | 6.548                 | -684       | -1.363  | -0,06      | -0,01            | -5.424  | -10.056        |                       |
| BBVA RMBS 5 FTA           | 7.244                 | -8.849     | -1.297  | -0,03      | -0,01            | -6.081  | -10.595        |                       |
| BBVA RMBS 9, FTA          | 2.515                 | -710       | -1.175  | -0,08      | -0,08            | -301    | -762           |                       |
| BBVA-3 FTPYME FTA         | 155                   | -134       | -41     | -0,07      | -0,05            | -112    | 0              |                       |

| FONDO                                 | GASTOS DE EXPLOTACIÓN |            |         |            |                  |        | DETERIORO RTDO | ACTIVOS NC EN VTA (5) |
|---------------------------------------|-----------------------|------------|---------|------------|------------------|--------|----------------|-----------------------|
|                                       | MI (1)                | INT EC (2) | IMPORTE | % / TA (3) | % COMISIONES (4) |        |                |                       |
| BBVA-4 PYME, FTA                      | 1.209                 | -211       | -64     | -0,09      | -0,04            | 73     | -438           |                       |
| BBVA-5 FTPYME, FTA                    | 949                   | -523       | -482    | -0,25      | -0,02            | 19     | -889           |                       |
| BBVA-6 FTPYME FTA                     | 711                   | -383       | -83     | -0,04      | -0,02            | -685   | -380           |                       |
| BBVA-7 FTGENCAT, FTA                  | 98                    | -154       | -73     | -0,14      | -0,06            | 697    | 0              |                       |
| BBVA-8 FTPYME FTA                     | 318                   | -900       | -322    | -0,11      | -0,02            | -1.293 | -449           |                       |
| BBVA-9 PYME FTA                       | 380                   | -3         | -378    | -0,07      | -0,07            | 0      | 0              |                       |
| BCL MUNICIPIOS I FTA                  | 67                    | -214       | -10     | -0,01      | 0,00             | 0      | 0              |                       |
| CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA              | 2.242                 | -71        | -2.030  | -0,39      | -0,39            | -141   | 0              |                       |
| CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA              | 1.712                 | -118       | -1.600  | -0,37      | -0,36            | 5      | 0              |                       |
| CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA    | 321                   | -307       | -48     | -0,02      | -0,01            | -669   | 0              |                       |
| CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA        | 923                   | -98        | -1.178  | -0,52      | -0,51            | 309    | 0              |                       |
| CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA            | 1.611                 | -172       | -1.488  | -0,61      | -0,60            | -3     | 0              |                       |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, FTA    | 60                    | -491       | -236    | -0,01      | 0,00             | 0      | 0              |                       |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 5, FTA    | 70                    | 0          | -132    | -0,01      | 0,00             | 0      | 0              |                       |
| CEDULAS TDA 15, FTA                   | 0                     | -430       | -1      | 0,00       | 0,00             | 0      | 0              |                       |
| CEDULAS TDA 17, FTA                   | 0                     | -497       | -6      | 0,00       | 0,00             | 0      | 0              |                       |
| CEDULAS TDA 18, FTA                   | 125                   | -113       | -231    | -0,03      | -0,01            | 0      | 0              |                       |
| CEDULAS TDA 2, FTA                    | 91                    | -574       | -44     | 0,00       | 0,00             | 0      | 0              |                       |
| CEDULAS TDA 21, FONDO DE TITULIZACION | 0                     | -2.585     | -8      | 0,00       | 0,00             | 0      | 0              |                       |
| CEDULAS TDA 3, FTA                    | 101                   | -565       | -20     | 0,00       | 0,00             | 0      | 0              |                       |
| CEDULAS TDA 5, FTA                    | 0                     | 0          | -5      | 0,00       | 0,00             | 0      | 0              |                       |
| CEDULAS TDA 6, FTA                    | 0                     | 0          | -13     | 0,00       | 0,00             | 0      | 0              |                       |
| CEDULAS TDA 7, FTA                    | 0                     | 0          | -12     | 0,00       | 0,00             | 0      | 0              |                       |
| CIBELES III FTPYME, FTA               | -125                  | -90        | -97     | -0,12      | -0,01            | 41     | 0              |                       |
| CM BANCAJA 1, FTA                     | -437                  | -1         | -55     | -0,06      | -0,04            | 6      | 0              |                       |
| CONSUMO BANCAJA 1, FTA                | 200                   | -18        | -25     | -0,12      | -0,07            | -190   | 0              |                       |
| DRIVER ESPAÑA ONE, FTA                | 2.507                 | -349       | -1.915  | -0,62      | -0,60            | -2.160 | 0              |                       |
| EDT FTPYME PASTOR 3, FTA              | 175                   | -161       | -105    | -0,20      | -0,04            | -260   | 0              |                       |
| EMPRESAS BANESTO 2, FTA               | 119                   | -1.123     | -191    | -0,03      | -0,08            | -9.739 | -638           |                       |

| FONDO  | GASTOS DE EXPLOTACIÓN |            |         |            |                  |         | DETERIORO RTDO | ACTIVOS NC EN VTA (5) |
|--|-----------------------|------------|---------|------------|------------------|---------|----------------|-----------------------|
|  | MI (1)                | INT EC (2) | IMPORTE | % / TA (3) | % COMISIONES (4) |         |                |                       |
| EMPRESAS BANESTO 5, FTA                                    | 760                   | -1.984     | 243     | 0,03       | 0,05             | -7.264  | -687           |                       |
| EMPRESAS BANESTO 6, FTA                                    | -164                  | -4         | 5.546   | 0,60       | 0,60             | -2.055  | 0              |                       |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 3, FTA                        | 153                   | -109       | -61     | -0,03      | -0,02            | -3.323  | 0              |                       |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 5, FTA                        | 1.016                 | -63        | -91     | -0,01      | -0,01            | -2.253  | 0              |                       |
| FTA PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZ. DE CED. HIPOTECARIA | 184                   | 0          | -96     | -0,01      | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| FINANCAT 1, FTA  | 869                   | -1         | -4.192  | -3,54      | -0,03            | -2.073  | -3             |                       |
| FINANCIACION BANESTO 1, FTA                                | 381                   | -123       | 693     | 1,70       | 1,72             | 243     | -10            |                       |
| FONCAIXA AUTONOMOS 1, FTA                                  | 3.292                 | -1.978     | -162    | -0,01      | -0,01            | -6.840  | 0              |                       |
| FONCAIXA CONSUMO 1, FTA                                    | 12.100                | -1.910     | -3.027  | -0,11      | -0,11            | -10.050 | 0              |                       |
| FONCAIXA EMPRESAS 3, FTA                                   | 3.057                 | -1.685     | -609    | -0,05      | -0,05            | -11.596 | 0              |                       |
| FONCAIXA FTGENCAT 3, FTA                                   | 399                   | -12        | 194     | 0,11       | 0,12             | -2.177  | 0              |                       |
| FONCAIXA FTGENCAT 4, FTA                                   | 522                   | -9         | 227     | 0,11       | 0,12             | -543    | 0              |                       |
| FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA                                   | 702                   | 0          | -48     | -0,01      | -0,01            | -4.497  | 0              |                       |
| FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA                                   | 560                   | 0          | -4      | 0,00       | 0,00             | -3.122  | 0              |                       |
| FONCAIXA LEASINGS 1, FTA                                   | 4.319                 | -2.622     | -122    | -0,01      | -0,01            | -8.126  | 0              |                       |
| FONCAIXA PYMES 3, FTA                                      | 5.510                 | -547       | -4.091  | -0,15      | -0,14            | -964    | 0              |                       |
| FTA FTPYME SANTANDER 1                                     | 838                   | -105       | -435    | -0,16      | -0,13            | -409    | -55            |                       |
| FTA FTPYME SANTANDER 2                                     | 1.131                 | -105       | -893    | -0,24      | -0,21            | -456    | -351           |                       |
| FTA PYMES SANTANDER 3                                      | 22.681                | -4         | -7.997  | -0,46      | -0,41            | -20.173 | 0              |                       |
| FTA PYMES SANTANDER 4                                      | 14.335                | -1         | -10.051 | -0,32      | -0,29            | -16.884 | 0              |                       |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 07-1                     | 1.586                 | -7         | 5.303   | 2,44       | 2,44             | 766     | 0              |                       |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2011-1                   | 4.941                 | -9         | -2.805  | -0,39      | -0,38            | -2.271  | 0              |                       |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2012-1                   | 4.490                 | -640       | -3.989  | -0,69      | -0,58            | -5      | 0              |                       |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 10, FTA                             | 1.763                 | -4         | -388    | -0,01      | -0,01            | -28.683 | -332           |                       |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 2                                   | 561                   | -1         | -249    | -0,07      | -0,04            | -1.052  | -1.778         |                       |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 4                                   | 2.591                 | -3         | -769    | -0,10      | -0,01            | -31.626 | 0              |                       |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 8, FTA                              | 5.793                 | -3         | 169     | 0,00       | -0,01            | -58.684 | -10.793        |                       |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 9, FTA                              | 2.754                 | -2         | -477    | -0,02      | -0,01            | -57.411 | -7.785         |                       |

| FONDO  | GASTOS DE EXPLOTACIÓN |            |         |            |                  |         | DETERIORO RTDO ACTIVOS NC EN VTA (5) |
|--|-----------------------|------------|---------|------------|------------------|---------|--------------------------------------|
|  | MI (1)                | INT EC (2) | IMPORTE | % / TA (3) | % COMISIONES (4) |         |                                      |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 1                                 | 1.735                 | -3         | -83     | -0,05      | -0,03            | 812     | -27                                  |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 5                                 | 11.972                | -4         | -4.865  | -0,62      | -0,62            | -10.614 | 0                                    |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2                                  | 2.132                 | -15        | 4.215   | 0,44       | 0,08             | -1.132  | -9.154                               |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3                                  | 8.063                 | -7         | -2.224  | -0,14      | -0,01            | -5.973  | -17.570                              |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 6                                  | 1.544                 | -2         | -1.004  | -0,09      | -0,06            | -4.459  | -2.696                               |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 7                                  | 3.995                 | -2         | -4.487  | -0,24      | -0,23            | -4.402  | -711                                 |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 8                                  | 1.519                 | -3         | -433    | -0,05      | -0,05            | -2.293  | 0                                    |
| FTA SANTANDER PUBLICO 1                                      | 265                   | -81        | -358    | -0,11      | -0,11            | 59      | 0                                    |
| FTA UCI 11   | 3.317                 | -67        | -2.545  | -0,95      | -0,92            | -91     | -271                                 |
| FTA UCI 14   | 9.134                 | -122       | -634    | -0,09      | -0,01            | -682    | -4.373                               |
| FTA UCI 16   | 13.881                | -10        | -10.171 | -0,92      | -0,83            | -695    | -12.578                              |
| FTA UCI 18   | 8.811                 | 0          | -7.995  | -0,68      | -0,42            | -879    | 0                                    |
| FTA UCI 6  | 535                   | -45        | -387    | -0,70      | -0,68            | -21     | 1                                    |
| FTA UCI 7  | 665                   | -34        | -596    | -0,92      | -0,88            | 0       | 0                                    |
| FTA UCI 8  | 964                   | -50        | -821    | -0,91      | -0,88            | -14     | -27                                  |
| FTA UCI 9  | 2.409                 | -136       | -2.251  | -0,92      | -0,90            | -3      | -28                                  |
| FTA, HIPOTEBANSA 11  | 1.302                 | -45        | -655    | -0,27      | -0,29            | -125    | -173                                 |
| FTA, HIPOTEBANSA X   | 768                   | -33        | -622    | -0,43      | -0,42            | -14     | -90                                  |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 1                                    | 825                   | -155       | 913     | 0,24       | 0,28             | -3.026  | -1.010                               |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 3                                    | 1.613                 | -7         | 1.621   | 0,22       | 0,27             | 539     | -3.327                               |
| FTA, UCI 15  | 9.800                 | 0          | -4.168  | -0,53      | -0,44            | -486    | -5.274                               |
| FTA, UCI 17  | 8.317                 | -20        | 644     | 0,07       | -0,03            | -937    | -9.671                               |
| FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA | 14.181                | 0          | -14.182 | -0,09      | -0,06            | 0       | 0                                    |
| FTH UCI 10   | 1.869                 | -32        | -1.817  | -1,01      | -0,99            | 1       | -23                                  |
| FTH UCI 12   | 4.822                 | -52        | -3.436  | -0,94      | -0,90            | 48      | -495                                 |
| FTH UCI 5  | 256                   | -26        | -199    | -0,78      | -0,76            | -1      | -1                                   |
| FTPyme BANCAJA 2 FTA   | 60                    | -38        | -26     | -0,06      | -0,05            | -21     | 0                                    |
| FTPyme BANCAJA 3 FTA   | 203                   | -97        | -81     | -0,11      | -0,09            | -46     | 0                                    |

| FONDO                              | GASTOS DE EXPLOTACIÓN |            |         |            |                  |         | DETERIORO RTDO | ACTIVOS NC EN VTA (5) |
|------------------------------------|-----------------------|------------|---------|------------|------------------|---------|----------------|-----------------------|
|                                    | MI (1)                | INT EC (2) | IMPORTE | % / TA (3) | % COMISIONES (4) |         |                |                       |
| FTPYME BANCAJA 6 FTA               | -563                  | -53        | -44     | -0,02      | -0,02            | -72     | 0              |                       |
| FTPYME TDA 6, FTA                  | 37                    | -11        | -44     | -0,20      | -0,16            | 11      | 0              |                       |
| FTPYME TDA 7, FTA                  | -205                  | -3         | -30     | -0,04      | -0,03            | -3.729  | 0              |                       |
| FTPYME TDA CAM 2, FTA              | 128                   | -62        | -37     | -0,04      | -0,03            | -861    | 0              |                       |
| FTPYME TDA CAM 4, FTA              | -1.095                | -42        | -58     | -0,02      | -0,01            | -2.481  | 0              |                       |
| FTPYME TDA CAM 7, FTA              | 695                   | -486       | -84     | -0,01      | -0,01            | -5.493  | 0              |                       |
| FTPYME TDA CAM 9, FTA              | 5.421                 | -1.306     | -71     | -0,01      | -0,01            | -11.630 | 0              |                       |
| GAT FTGENCAT 2005, FTA             | 208                   | -96        | -74     | -0,09      | -0,04            | 1.348   | 0              |                       |
| GAT FTGENCAT 2006, FTA             | 70                    | -1         | -88     | -0,13      | -0,04            | -2.161  | -17            |                       |
| GAT FTGENCAT 2007, FTA             | 58                    | -1         | -107    | -0,06      | -0,02            | -6.495  | -3             |                       |
| GAT FTGENCAT 2008, FTA             | 711                   | -90        | -140    | -0,05      | -0,01            | -10.513 | 66             |                       |
| GAT FTGENCAT 2009, FTA             | 3.985                 | -678       | -118    | -0,04      | -0,01            | -13.011 | 0              |                       |
| GAT ICO-FTVPO 1, FTH               | 240                   | -2         | -291    | -0,11      | -0,06            | -175    | 0              |                       |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 1, FTA  | 401                   | 0          | -17     | -0,02      | 0,00             | -5.587  | 0              |                       |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 2, FTA  | -294                  | -2         | 209     | 0,14       | 0,16             | -2.221  | 0              |                       |
| GC FTGENCAT CAIXA TARRAGONA 1, FTA | -116                  | -1         | -64     | -0,05      | -0,02            | -2.590  | 0              |                       |
| GC FTGENCAT SABADELL 1, FTA        | 372                   | -94        | 1.278   | 1,22       | 1,22             | 1.805   | 0              |                       |
| GC FTPYME PASTOR 4, FTA            | 265                   | -124       | -95     | -0,10      | -0,03            | -603    | -227           |                       |
| GC FTPYME SABADELL 4, FTA          | 320                   | -79        | 817     | 0,71       | 0,72             | -1.055  | 0              |                       |
| GC FTPYME SABADELL 5, FTA          | 622                   | -135       | 2.893   | 1,20       | 1,21             | -757    | 0              |                       |
| GC FTPYME SABADELL 6, FTA          | 690                   | -176       | 1.227   | 0,46       | 0,47             | -3.427  | 0              |                       |
| GC FTPYME SABADELL 8, FTA          | 1.929                 | -657       | -371    | -0,06      | -0,05            | -3.937  | 0              |                       |
| GC FTPYME UNNIM 1, FTA             | 1.033                 | -403       | -100    | -0,04      | -0,02            | -3.099  | 0              |                       |
| GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA       | 726                   | -9         | -202    | -0,05      | -0,02            | -4.658  | -898           |                       |
| GC SABADELL 1, FTH                 | 954                   | -68        | -855    | -0,23      | -0,23            | -11     | 0              |                       |
| GC SABADELL EMPRESAS 2, FTA        | 356                   | -388       | 720     | 0,27       | 0,28             | 100     | 0              |                       |
| GC SABADELL EMPRESAS 4, FTA        | 356                   | -847       | -54     | -0,02      | -0,01            | -4.850  | 0              |                       |
| HIPOCAT 10, FTA                    | 2.422                 | 0          | -361    | -0,05      | -0,02            | -5.362  | -931           |                       |
| HIPOCAT 11, FTA                    | 2.760                 | 0          | -462    | -0,07      | -0,02            | -6.529  | -1.414         |                       |

| FONDO                           | GASTOS DE EXPLOTACIÓN |            |         |            |                  |        | DETERIORO RTDO | ACTIVOS NC EN VTA (5) |
|---------------------------------|-----------------------|------------|---------|------------|------------------|--------|----------------|-----------------------|
|                                 | MI (1)                | INT EC (2) | IMPORTE | % / TA (3) | % COMISIONES (4) |        |                |                       |
| HIPOCAT 14, FTA                 | 972                   | 0          | -212    | -0,05      | -0,04            | -848   | -104           |                       |
| HIPOCAT 16, FTA                 | 1.946                 | -37        | -1.902  | -0,30      | -0,29            | 3      | -114           |                       |
| HIPOCAT 17, FTA                 | 2.626                 | -647       | -233    | -0,03      | -0,01            | -1.933 | -414           |                       |
| HIPOCAT 18, FTA                 | 5.398                 | -113       | -5.026  | -0,74      | -0,70            | -403   | -14            |                       |
| HIPOCAT 19, FTA                 | 7.598                 | -654       | -2.569  | -0,41      | -0,37            | -4.494 | 0              |                       |
| HIPOCAT 20, FTA                 | 10.400                | -794       | -7.950  | -0,95      | -0,93            | -1.796 | -42            |                       |
| HIPOCAT 4, FTA                  | 200                   | 0          | -193    | -0,33      | -0,29            | -1     | -22            |                       |
| HIPOCAT 5, FTA                  | 535                   | -14        | -462    | -0,30      | -0,28            | -103   | 0              |                       |
| HIPOCAT 6, FTA                  | 832                   | -36        | -696    | -0,29      | -0,28            | -151   | -23            |                       |
| HIPOCAT 7, FTA                  | 1.882                 | -39        | -999    | -0,20      | -0,18            | -1.027 | -90            |                       |
| HIPOCAT 8, FTA                  | 1.943                 | -35        | -255    | -0,04      | -0,02            | -2.988 | -155           |                       |
| HIPOCAT 9, FTA                  | 1.514                 | 0          | -226    | -0,05      | -0,02            | -1.795 | -403           |                       |
| ICO MEDIACION I AYT, FTA        | 956                   | -1.432     | -584    | -0,08      | -0,01            | 0      | 0              |                       |
| ICO MEDIACION II AYT FTA        | 60.282                | -57.149    | -33.769 | -0,20      | -0,01            | 0      | 0              |                       |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 1, FTA  | 616                   | -48        | -760    | -0,37      | -0,37            | 137    | 0              |                       |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 2, FTA  | 815                   | -1.307     | -430    | -0,09      | -0,07            | -604   | 0              |                       |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 3, FTA  | 15.526                | -631       | -11.568 | -1,03      | -1,03            | -4.398 | 0              |                       |
| IM BANCO POPULAR MBS 2, FTA     | 2.038                 | -542       | -874    | -0,14      | -0,13            | -944   | 0              |                       |
| IM BANKOA MBS 1, FTA            | 801                   | -398       | -420    | -0,10      | -0,09            | -63    | 0              |                       |
| IM BCG RMBS 1, FTA              | 538                   | -90        | -482    | -0,13      | -0,13            | -38    | 0              |                       |
| IM BES EMPRESAS 1, FTA          | 8.668                 | -83        | -4.925  | -1,25      | -1,24            | -8.510 | 0              |                       |
| IM CAJA LABORAL 1, FTA          | 704                   | 0          | -773    | -0,16      | -0,16            | -1     | 0              |                       |
| IM CAJA LABORAL 2, FTA          | 414                   | -99        | -235    | -0,05      | -0,04            | -249   | 0              |                       |
| IM CAJA LABORAL EMPRESAS 1, FTA | 2.990                 | -482       | -6.926  | -1,90      | -1,90            | 3.384  | 0              |                       |
| IM CAJAMAR 1, FTA               | 444                   | -8         | -512    | -0,40      | -0,39            | 63     | 0              |                       |
| IM CAJAMAR 3, FTA               | 1.615                 | -22        | -1.432  | -0,24      | -0,24            | -238   | 0              |                       |
| IM CAJAMAR 4, FTA               | 1.364                 | 0          | -1.274  | -0,22      | -0,22            | -151   | 0              |                       |
| IM CAJAMAR 5, FTA               | 1.598                 | -13        | -1.287  | -0,19      | -0,18            | -320   | 0              |                       |
| IM CAJAMAR 6, FTA               | 1.750                 | -61        | -1.304  | -0,09      | -0,09            | -585   | 0              |                       |

| FONDO                                  | GASTOS DE EXPLOTACIÓN |            |         |            |                  |         | DETERIORO RTDO | ACTIVOS NC EN VTA (5) |
|--|-----------------------|------------|---------|------------|------------------|---------|----------------|-----------------------|
|  | MI (1)                | INT EC (2) | IMPORTE | % / TA (3) | % COMISIONES (4) |         |                |                       |
| IM CAJAMAR EMPRESAS 2 FTPYME, FTA      | 581                   | -216       | -188    | -0,10      | -0,08            | -404    | 0              |                       |
| IM CAJAMAR EMPRESAS 4, FTA             | 15.227                | -2         | -12.114 | -1,24      | -1,24            | -3.211  | 0              |                       |
| IM CAJASTUR MBS 1, FTA                 | 1.734                 | -319       | -836    | -0,13      | -0,13            | -662    | 0              |                       |
| IM CEDULAS 1 GRUPO BANCO POPULAR, FTA  | 86                    | -492       | -287    | -0,01      | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| IM CEDULAS 10, FTA                     | 65                    | 0          | -195    | -0,01      | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| IM CEDULAS 14, FTA                     | 60                    | -506       | -99     | -0,01      | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| IM CEDULAS 15, FTA                     | 47                    | -899       | -153    | -0,02      | -0,01            | 0       | 0              |                       |
| IM CEDULAS 2, FTA                      | 75                    | 0          | -236    | -0,02      | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| IM CEDULAS 3, FTA                      | 53                    | 0          | -212    | -0,02      | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| IM CEDULAS 4, FTA                      | 103                   | 0          | -368    | -0,02      | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| IM CEDULAS 5, FTA                      | 62                    | 0          | -175    | -0,01      | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| IM CEDULAS 7, FTA                      | 62                    | 0          | -166    | -0,01      | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| IM CEDULAS 9, FTA                      | 63                    | 0          | -210    | -0,02      | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| IM CFS RMBS 1, FTA                     | 417                   | -14        | -1.615  | -0,41      | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| IM CITI TARJETAS 1, FTA                | 38.804                | -77        | -38.676 | -3,11      | -2,95            | -51     | 0              |                       |
| IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA            | 585                   | -93        | -2.475  | -1,36      | -1,35            | -63     | 0              |                       |
| IM FTGENCAT SABADELL 3, FTA            | 153                   | -110       | -152    | -0,16      | -0,12            | -252    | 0              |                       |
| IM FTGENCAT SABADELL 4, FTA            | 253                   | -369       | -320    | -0,17      | -0,16            | -633    | 0              |                       |
| IM FTPYME SABADELL 3, FTA              | 562                   | -61        | -1.312  | -1,70      | -1,69            | 718     | 0              |                       |
| IM FTPYME SABADELL 7, FTA              | 714                   | -596       | -193    | -0,05      | -0,02            | -1.144  | 0              |                       |
| IM FTPYME SABADELL 9, FTA              | 15.605                | -948       | -17.886 | -1,35      | -1,35            | -3.415  | 0              |                       |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, FTA | 2.525                 | -8         | -2.392  | -0,67      | -0,66            | -1.177  | 0              |                       |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 3, FTA | 4.143                 | -1.548     | -9.356  | -0,37      | -0,37            | -4.245  | 0              |                       |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 4, FTA | 13.681                | -1.908     | -1.362  | -0,09      | -0,09            | -21.186 | 0              |                       |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I FTA    | 3.359                 | -6         | -3.008  | -0,63      | -0,63            | -563    | 0              |                       |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME II, FTA  | 205                   | -6         | -457    | -0,14      | -0,13            | -791    | 0              |                       |
| IM GRUPO BANCO POPULAR LEASING 2, FTA  | 5.787                 | -2.134     | -838    | -0,08      | -0,08            | -12.762 | 0              |                       |
| IM PASTOR 2, FTH                       | 517                   | -20        | -447    | -0,16      | -0,15            | -53     | 0              |                       |
| IM PASTOR 3, FTH                       | 618                   | -137       | -209    | -0,06      | -0,01            | -432    | 52             |                       |



| FONDO                                | GASTOS DE EXPLOTACIÓN |            |         |            |                  |         | DETERIORO RTDO | ACTIVOS NC EN VTA (5) |
|--------------------------------------|-----------------------|------------|---------|------------|------------------|---------|----------------|-----------------------|
|                                      | MI (1)                | INT EC (2) | IMPORTE | % / TA (3) | % COMISIONES (4) |         |                |                       |
| IM PASTOR 4, FTA                     | 1.945                 | -84        | -494    | -0,11      | -0,08            | -599    | 56             |                       |
| IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, FTA     | -124                  | 0          | -210    | -0,11      | -0,11            | 0       | 0              |                       |
| IM SABADELL EMPRESAS 1, FTA          | 511                   | -223       | -426    | -0,22      | -0,20            | -317    | 0              |                       |
| IM SABADELL EMPRESAS 3, FTA          | 343                   | -1.903     | -2.181  | -0,25      | -0,25            | -5      | 0              |                       |
| IM SABADELL EMPRESAS 5, FTA          | 434                   | -735       | -1.120  | -0,36      | -0,35            | -77     | 0              |                       |
| IM SABADELL RMBS 2, FTA              | 1.843                 | -206       | -1.726  | -0,19      | -0,19            | -82     | 0              |                       |
| IM SABADELL RMBS 3, FTA              | 1.379                 | -392       | -944    | -0,10      | -0,09            | -182    | 0              |                       |
| IM TERRASSA 1 FTGENCAT FTA           | 237                   | -62        | -42     | -0,07      | -0,07            | -214    | 0              |                       |
| IM TERRASSA MBS 1, FTA               | 561                   | -107       | -53     | -0,02      | -0,02            | -3.105  | 0              |                       |
| INTERMONEY MASTER CEDULAS, FTA       | 83                    | 0          | -232    | -0,01      | 0,00             | 0       | 0              |                       |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS III, FTA | 19.757                | -2.732     | -1.895  | -0,23      | -0,22            | 0       | 0              |                       |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS IV, FTA  | 4.764                 | -2.823     | -2.518  | -0,30      | -0,28            | 0       | 0              |                       |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS V, FTA   | 11.709                | -2.992     | -8.398  | -0,71      | -0,71            | 0       | 0              |                       |
| MADRID CONSUMO I, FTA                | 3.717                 | -490       | -70     | -0,03      | -0,03            | -4.683  | 0              |                       |
| MADRID FTPYME I, FTA                 | 6.787                 | -2.405     | -106    | -0,01      | -0,01            | -7.187  | 0              |                       |
| MADRID FTPYME II, FTA                | 6.190                 | -1.504     | -104    | -0,01      | -0,01            | -5.357  | 0              |                       |
| MADRID ICO-FTVPO I, FTA              | 495                   | -254       | -62     | -0,03      | -0,03            | 1       | 0              |                       |
| MADRID RESIDENCIAL I, FTA            | 1.963                 | -1.371     | -126    | -0,02      | -0,02            | -1.693  | -31            |                       |
| MADRID RESIDENCIAL II, FTA           | 1.800                 | -991       | -115    | -0,02      | -0,01            | -1.228  | 0              |                       |
| MADRID RMBS I, FTA                   | 1.927                 | -798       | -144    | -0,01      | -0,01            | -10.546 | -1.404         |                       |
| MADRID RMBS II, FTA                  | 2.259                 | -845       | -127    | -0,01      | -0,01            | -6.811  | -1.610         |                       |
| MADRID RMBS III FTA                  | 5.108                 | -1.649     | -192    | -0,01      | -0,01            | -12.880 | -2.240         |                       |
| MADRID RMBS IV, FTA                  | 1.269                 | -3.586     | -208    | -0,01      | -0,01            | -10.766 | -1.894         |                       |
| MBS BANCAJA 1 FTA                    | 293                   | -110       | -208    | -0,17      | -0,16            | 3       | 0              |                       |
| MBS BANCAJA 2, FTA                   | 520                   | 0          | -568    | -0,22      | -0,21            | 21      | 0              |                       |
| MBS BANCAJA 3, FTA                   | 819                   | 0          | -809    | -0,23      | -0,23            | -46     | 0              |                       |
| MBS BANCAJA 4, FTA                   | 2.598                 | -17        | -2.821  | -0,28      | -0,28            | 164     | 0              |                       |
| MBS BANCAJA 6, FTA                   | 6.118                 | -713       | -4.881  | -0,59      | -0,58            | -691    | 0              |                       |
| MBS BANCAJA 7, FTA                   | 6.318                 | -114       | -4.605  | -0,55      | -0,55            | -1.707  | 0              |                       |

| FONDO                                     | GASTOS DE EXPLOTACIÓN |            |         |            |                  |        | DETERIORO RTDO | ACTIVOS NC EN VTA (5) |
|---|-----------------------|------------|---------|------------|------------------|--------|----------------|-----------------------|
|   | MI (1)                | INT EC (2) | IMPORTE | % / TA (3) | % COMISIONES (4) |        |                |                       |
| MBS BANCAJA 8, FTA                        | 3.326                 | -63        | -2.622  | -0,61      | -0,60            | -703   | 0              |                       |
| MBSCAT 1, FTA                             | 2.565                 | -684       | -172    | -0,02      | -0,01            | -4.829 | -793           |                       |
| MBSCAT 2, FTA                             | 4.925                 | -619       | -207    | -0,06      | -0,02            | -4.062 | -443           |                       |
| PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA                 | 0                     | -489       | -5      | 0,00       | 0,00             | 0      | 0              |                       |
| PYME BANCAJA 5, FTA                       | -359                  | -47        | -50     | -0,04      | -0,02            | 353    | 0              |                       |
| PYME BANCAJA 7, FTA                       | -376                  | -2.265     | -102    | -0,02      | -0,01            | -4.308 | 0              |                       |
| PYME VALENCIA 1, FTA                      | 387                   | -8         | -47     | -0,02      | -0,01            | -57    | -502           |                       |
| PYME VALENCIA 2, FTA                      | 1.513                 | -892       | -88     | -0,03      | -0,01            | -2.047 | -134           |                       |
| PYMECAT 2 FTPYME, FTA                     | 269                   | -71        | -182    | -0,12      | -0,02            | -7.911 | -479           |                       |
| PYMECAT 3 FTPYME, FTA                     | 5.206                 | -736       | -257    | -0,07      | -0,01            | -6.250 | 0              |                       |
| PYMES BANESTO 2, FTA                      | -347                  | -316       | -278    | -0,11      | -0,02            | -2.485 | 502            |                       |
| RURAL CEDULA I, FTA                       | 55                    | -171       | -63     | -0,01      | 0,00             | 0      | 0              |                       |
| RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA           | 743                   | 0          | -621    | -0,14      | -0,12            | -307   | 152            |                       |
| RURAL HIPOTECARIO II FTH                  | 306                   | -17        | -297    | -1,14      | -1,12            | 0      | 3              |                       |
| RURAL HIPOTECARIO III FTH                 | 699                   | -25        | -683    | -1,21      | -1,20            | 0      | 0              |                       |
| RURAL HIPOTECARIO IV FTH                  | 1.292                 | -43        | -1.264  | -1,14      | -1,14            | 0      | 0              |                       |
| RURAL HIPOTECARIO IX, FTA                 | 2.202                 | -8         | -1.275  | -0,14      | -0,12            | -472   | -499           |                       |
| RURAL HIPOTECARIO V FTA                   | 1.786                 | -65        | -1.741  | -0,89      | -0,89            | -5     | 0              |                       |
| RURAL HIPOTECARIO VI, FTA                 | 865                   | -53        | -822    | -0,25      | -0,25            | 3      | -17            |                       |
| RURAL HIPOTECARIO VII, FTA                | 1.151                 | -70        | -1.071  | -0,25      | -0,24            | -24    | -18            |                       |
| RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA               | 1.776                 | 0          | -1.636  | -0,24      | -0,24            | -82    | -97            |                       |
| RURAL HIPOTECARIO X, FTA                  | 2.482                 | -339       | -1.829  | -0,13      | -0,12            | -132   | -301           |                       |
| RURAL HIPOTECARIO XI, FTA                 | 3.114                 | -662       | -842    | -0,05      | -0,04            | -667   | -647           |                       |
| RURAL HIPOTECARIO XII, FTA                | 1.602                 | -377       | -1.088  | -0,13      | -0,13            | -119   | -131           |                       |
| RURALPYME 1 FTPYME FTA                    | 0                     | -66        | -30     | -0,09      | -0,04            | 112    | 16             |                       |
| RURALPYME 2 FTPYME FTA                    | 565                   | -18        | -162    | -0,10      | -0,09            | 813    | -41            |                       |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN 09-1, FTA        | 1.299                 | 0          | -45     | -0,02      | -0,01            | -956   | 0              |                       |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2010-1, FTA | 2.787                 | -1         | -1.692  | -0,47      | -0,47            | -1.410 | 0              |                       |
| SANTANDER HIPOTECARIO I, FTA              | 1.529                 | -110       | -1.432  | -0,22      | -0,21            | -320   | -395           |                       |

| FONDO               | GASTOS DE EXPLOTACIÓN |            |         |            |                  |        | DETERIORO RTDO | ACTIVOS NC EN VTA (5) |
|---------------------|-----------------------|------------|---------|------------|------------------|--------|----------------|-----------------------|
|                     | MI (1)                | INT EC (2) | IMPORTE | % / TA (3) | % COMISIONES (4) |        |                |                       |
| SOL-LION, FTA       | 6.168                 | -230       | -6.320  | -0,18      | -0,18            | 58     | 0              |                       |
| TDA 11, FTH         | 701                   | -72        | -662    | -1,05      | -1,04            | 7      | 0              |                       |
| TDA 12, FTH         | 762                   | -37        | -748    | -1,29      | -1,29            | 2      | 0              |                       |
| TDA 13 - MIXTO, FTA | 700                   | -28        | -694    | -1,21      | -1,21            | 5      | 0              |                       |
| TDA 14 - MIXTO, FTA | 1.577                 | -53        | -1.556  | -1,40      | -1,39            | 3      | 0              |                       |
| TDA 15 - MIXTO, FTA | 1.226                 | -41        | -1.216  | -1,08      | -1,07            | 7      | 0              |                       |
| TDA 16 - MIXTO, FTA | 1.317                 | -65        | -1.259  | -1,05      | -0,99            | -35    | 0              |                       |
| TDA 17 - MIXTO, FTA | 1.275                 | -70        | -1.249  | -1,29      | -1,28            | 11     | 0              |                       |
| TDA 18 - MIXTO, FTA | 1.098                 | -56        | -1.083  | -0,90      | -0,90            | 3      | 0              |                       |
| TDA 19 - MIXTO, FTA | 1.042                 | -85        | -982    | -0,51      | -0,51            | 25     | 0              |                       |
| TDA 20 - MIXTO, FTA | 675                   | -60        | -673    | -0,47      | -0,46            | 22     | 0              |                       |
| TDA 22 - MIXTO, FTA | 649                   | -39        | -447    | -0,24      | -0,17            | -163   | 0              |                       |
| TDA 23, FTA         | 539                   | -76        | -541    | -0,17      | -0,17            | 60     | 0              |                       |
| TDA 24, FTA         | 487                   | 0          | -385    | -0,18      | -0,03            | -343   | -58            |                       |
| TDA 25, FTA         | 289                   | -1         | -539    | -0,36      | -0,03            | -2.194 | -16            |                       |
| TDA 26 - MIXTO, FTA | 761                   | 0          | -878    | -0,23      | -0,23            | 76     | 0              |                       |
| TDA 27, FTA         | 816                   | -76        | -867    | -0,16      | -0,06            | 133    | -7             |                       |
| TDA 28, FTA         | 334                   | -8         | -882    | -0,28      | -0,03            | -3.264 | -356           |                       |
| TDA 29, FTA         | 1.066                 | -2         | -1.181  | -0,25      | -0,25            | 84     | 0              |                       |
| TDA 30, FTA         | 374                   | 0          | -515    | -0,17      | -0,17            | 108    | 0              |                       |
| TDA 31, FTA         | 493                   | -35        | -237    | -0,12      | -0,12            | -244   | 0              |                       |
| TDA CAJAMAR 2, FTA  | 1.221                 | 0          | -1.265  | -0,32      | -0,32            | 41     | 0              |                       |
| TDA CAM 1, FTA      | 779                   | -77        | -792    | -0,33      | -0,33            | 37     | 0              |                       |
| TDA CAM 10, FTA     | 951                   | -28        | -2.545  | -0,34      | -0,34            | 1.522  | 0              |                       |
| TDA CAM 11, FTA     | 2.303                 | -148       | -2.226  | -0,17      | -0,17            | -397   | 0              |                       |
| TDA CAM 12, FTA     | 2.625                 | -26        | -617    | -0,04      | -0,04            | -2.464 | 0              |                       |
| TDA CAM 2, FTA      | 661                   | -61        | -708    | -0,26      | -0,25            | 56     | 0              |                       |
| TDA CAM 3, FTA      | 926                   | -64        | -974    | -0,32      | -0,32            | 42     | 0              |                       |
| TDA CAM 4, FTA      | 1.923                 | -146       | -2.049  | -0,29      | -0,29            | 167    | 0              |                       |

| FONDO                                   | GASTOS DE EXPLOTACIÓN |            |         |            |                  |        | DETERIORO RTDO | ACTIVOS NC EN VTA (5) |
|---|-----------------------|------------|---------|------------|------------------|--------|----------------|-----------------------|
|   | MI (1)                | INT EC (2) | IMPORTE | % / TA (3) | % COMISIONES (4) |        |                |                       |
| TDA CAM 5, FTA                          | 2.248                 | -149       | -2.705  | -0,28      | -0,27            | 479    | 0              |                       |
| TDA CAM 6, FTA                          | 1.397                 | -115       | -1.705  | -0,26      | -0,26            | 339    | 0              |                       |
| TDA CAM 7, FTA                          | 2.212                 | -179       | -2.755  | -0,28      | -0,28            | 602    | 0              |                       |
| TDA CAM 8, FTA                          | 1.827                 | -37        | -2.381  | -0,24      | -0,24            | 512    | 0              |                       |
| TDA CAM 9, FTA                          | 1.426                 | -37        | -1.893  | -0,21      | -0,21            | 420    | 0              |                       |
| TDA CORPORATIVOS I, FTA                 | 706                   | -3.557     | -69     | -0,01      | -0,01            | -1.995 | 0              |                       |
| TDA EMPRESAS 1, FTA                     | 124                   | -121       | -62     | -0,10      | -0,06            | -5.434 | 0              |                       |
| TDA EMPRESAS 2, FTA                     | 644                   | -356       | -30     | -0,03      | -0,02            | -4.251 | 0              |                       |
| TDA FTPYME PASTOR 9, FTA                | 3.014                 | -675       | -34     | -0,01      | -0,01            | -5.215 | 0              |                       |
| TDA IBERCAJA 1, FTA                     | 403                   | -30        | -394    | -0,22      | -0,21            | 2      | 0              |                       |
| TDA IBERCAJA 2, FTA                     | 940                   | 0          | -978    | -0,24      | -0,23            | 12     | 0              |                       |
| TDA IBERCAJA 3, FTA                     | 865                   | 0          | -935    | -0,19      | -0,18            | 33     | 0              |                       |
| TDA IBERCAJA 4, FTA                     | 1.118                 | 0          | -932    | -0,12      | -0,12            | -237   | 0              |                       |
| TDA IBERCAJA 5, FTA                     | 1.154                 | 0          | -804    | -0,11      | -0,11            | -391   | 0              |                       |
| TDA IBERCAJA 6, FTA                     | 128                   | -191       | -134    | -0,01      | -0,01            | -855   | 0              |                       |
| TDA IBERCAJA 7, FTA                     | 887                   | 0          | -805    | -0,05      | -0,04            | -269   | 0              |                       |
| TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH             | -35                   | -9         | -70     | -0,02      | -0,01            | 149    | 0              |                       |
| TDA LICO LEASING III, FTA               | 1.299                 | -413       | -901    | -0,63      | -0,46            | 0      | 0              |                       |
| TDA PASTOR 1, FTA                       | 505                   | -14        | -516    | -0,49      | -0,49            | 4      | 0              |                       |
| TDA PASTOR CONSUMO 1, FTA               | 171                   | -89        | -57     | -0,18      | -0,11            | -1.239 | 0              |                       |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA           | -120                  | -135       | -42     | -0,06      | -0,04            | 40     | 0              |                       |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA           | -48                   | -306       | -36     | -0,02      | -0,02            | 297    | 0              |                       |
| TDA TARRAGONA 1, FTA                    | -27                   | -8         | -68     | -0,02      | -0,01            | -191   | 0              |                       |
| UNICAJA ANDALUCIA FTVIVIENDA TDA 1, FTA | 287                   | -112       | -245    | -0,14      | -0,13            | 32     | 0              |                       |
| UNICAJA AYT EMPRESAS I, FTA             | 784                   | -207       | -85     | -0,06      | -0,02            | -508   | 0              |                       |
| UNICAJA TDA VPO, FTA                    | 303                   | -69        | -362    | -0,22      | -0,20            | 102    | 0              |                       |
| VAL BANCAJA 1, FTA                      | 1.948                 | -296       | -1.492  | -0,53      | -0,52            | -222   | 0              |                       |
| VALENCIA HIPOTECARIO 1, FTA             | 375                   | -75        | -269    | -0,19      | -0,18            | 2      | -52            |                       |
| VALENCIA HIPOTECARIO 2, FTH             | 1.322                 | 0          | -610    | -0,14      | -0,13            | -86    | -676           |                       |

| FONDO                          | GASTOS DE EXPLOTACIÓN |                 |                 |               |                  |                 | DETERIORO RTDO ACTIVOS NC EN VTA (5) |
|--------------------------------|-----------------------|-----------------|-----------------|---------------|------------------|-----------------|--------------------------------------|
|                                | MI (1)                | INT EC (2)      | IMPORTE         | % / TA (3)    | % COMISIONES (4) |                 |                                      |
| VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA    | 1.455                 | -6              | -655            | -0,13         | -0,12            | -81             | -759                                 |
| VALENCIA HIPOTECARIO 4, FTA    | 393                   | -5              | -240            | -0,04         | -0,01            | -896            | -3.997                               |
| VALENCIA HIPOTECARIO 5, FTA    | 831                   | -357            | -130            | -0,03         | -0,01            | -484            | -1.332                               |
| <b>Subtotal BONOS 2012 2</b>   | <b>850.438</b>        | <b>-212.699</b> | <b>-459.723</b> | <b>-0,13</b>  | <b>-0,11</b>     | <b>-763.760</b> | <b>-149.145</b>                      |
| <b>Subtotal BONOS 2011 2</b>   | <b>855.406</b>        | <b>-376.290</b> | <b>-495.019</b> | <b>-0,11</b>  | <b>-0,08</b>     | <b>-749.581</b> | <b>-175.244</b>                      |
| <b>%Variación</b>              | <b>-0,58</b>          | <b>-43,47</b>   | <b>-7,13</b>    | <b>18,18</b>  | <b>37,50</b>     | <b>1,89</b>     | <b>-14,89</b>                        |
| <b>PAGARÉS</b>                 |                       |                 |                 |               |                  |                 |                                      |
| FTA SANTANDER 2                | 17.637                | -3.373          | -22.801         | -1,42         | -1,41            | 48.026          | -62.239                              |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2012 2</b> | <b>17.637</b>         | <b>-3.373</b>   | <b>-22.801</b>  | <b>-1,42</b>  | <b>-1,41</b>     | <b>48.026</b>   | <b>-62.239</b>                       |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2011 2</b> | <b>18.230</b>         | <b>-2.113</b>   | <b>-3.046</b>   | <b>-0,18</b>  | <b>-0,15</b>     | <b>-24.262</b>  | <b>0</b>                             |
| <b>%Variación</b>              | <b>-3</b>             | <b>59,63</b>    | <b>648,56</b>   | <b>688,89</b> | <b>840,00</b>    | <b>-297,95</b>  | <b>-</b>                             |
| <b>Total 2012 2</b>            | <b>868.075</b>        | <b>-216.072</b> | <b>-482.524</b> | <b>-0,13</b>  | <b>-0,11</b>     | <b>-715.734</b> | <b>-211.384</b>                      |
| <b>Total 2011 2</b>            | <b>873.636</b>        | <b>-378.403</b> | <b>-498.065</b> | <b>-0,11</b>  | <b>-0,08</b>     | <b>-773.843</b> | <b>-175.244</b>                      |
| <b>%Variación</b>              | <b>-0,64</b>          | <b>-42,90</b>   | <b>-3,12</b>    | <b>18,18</b>  | <b>37,50</b>     | <b>-7,51</b>    | <b>20,62</b>                         |

Nota: Importes en miles de euros

(1) Importe de los intereses provenientes de derechos de crédito menos los devengados por los valores emitidos por el fondo, más el resultado de las operaciones de cobertura de flujos de efectivo (swap)

(2) Intereses de deudas con entidades de crédito

(3) Porcentaje que representan los gastos de explotación sobre el total activo

(4) Porcentaje que representa el importe del gasto por comisiones sobre el total activo

(5) Importe de las ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta

| FONDO                                   | %Variación MI (1) | INT DCHOS CREDITO<br>(2) | INT OBLIGACIONES (3) | RESULTADO DEL<br>SWAP | TIPO INT DCHOS<br>CREDITO (4) | TIPO INTERÉS<br>OBLIGACIONES (5) | EXCESO SPREAD (%) |
|---|-------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------------|----------------------------------|-------------------|
| <b>BONOS</b>                            |                   |                          |                      |                       |                               |                                  |                   |
| AUTO ABS 2012-3, FTA                    | 0,00              | 7.171                    | -2.373               | 0                     | 8,63                          | 3,28                             | 5,35              |
| AYT ANDALUCIA FTEMPRESA CAJAMAR, FTA    | -50,75            | 2.963                    | -920                 | -1.550                | 3,65                          | 1,61                             | 2,04              |
| AYT CAIXA GALICIA EMPRESAS I, FTA       | 247,05            | 3.161                    | -2.901               | -1.787                | 3,58                          | 1,92                             | 1,66              |
| AYT CAIXA SABADELL HIPOTECARIO I, FTA   | -32,75            | 4.484                    | -1.714               | -2.228                | 3,33                          | 1,91                             | 1,42              |
| AYT CAIXANOVA FTPYME I, FTA             | -104,46           | 1.050                    | -622                 | -541                  | 4,04                          | 3,27                             | 0,00              |
| AYT CAIXANOVA HIPOTECARIO I, FTA        | -97,13            | 2.895                    | -897                 | -1.952                | 3,57                          | 1,53                             | 2,04              |
| AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA              | 0,00              | 10.136                   | -3.438               | 0                     | 4,08                          | 1,76                             | 2,32              |
| AYT CAJA MURCIA HIPOTECARIO I, FTA      | -56,79            | 1.677                    | -364                 | -871                  | 2,99                          | 1,25                             | 1,74              |
| AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA      | -111,75           | 3.524                    | -672                 | -2.923                | 3,60                          | 1,11                             | 2,49              |
| AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FTA      | -45,45            | 1.818                    | -438                 | -817                  | 2,92                          | 1,32                             | 1,60              |
| AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA            | -53,53            | 554.695                  | -552.828             | 0                     | 2,53                          | 3,23                             | 0,00              |
| AYT CEDULAS CAJAS IV, FTA               | -49,82            | 76.761                   | -76.625              | 0                     | 4,01                          | 4,00                             | 0,00              |
| AYT CEDULAS CAJAS IX, FTA               | -49,66            | 96.484                   | -96.411              | 0                     | 3,83                          | 3,88                             | 0,00              |
| AYT CEDULAS CAJAS V, FTA                | -49,77            | 72.912                   | -72.803              | 0                     | 4,68                          | 4,63                             | 0,00              |
| AYT CEDULAS CAJAS VI, FTA               | -52,91            | 66.632                   | -66.543              | 0                     | 4,01                          | 4,00                             | 0,01              |
| AYT CEDULAS CAJAS VIII, FTA             | -50,56            | 84.023                   | -83.891              | 0                     | 4,07                          | 4,13                             | 0,00              |
| AYT CEDULAS CAJAS X, FTA                | -49,39            | 42.781                   | -42.656              | 0                     | 4,95                          | 2,30                             | 0,00              |
| AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FTA    | -192,71           | 6.896                    | -4.005               | -4.074                | 3,08                          | 2,51                             | 0,00              |
| AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA | -80,96            | 66.782                   | -29.332              | -34.254               | 2,86                          | 1,86                             | 0,00              |
| AYT DEUDA SUBORDINADA I, FTA            | 103,67            | 1.875                    | -987                 | 0                     | 1,53                          | 1,16                             | 0,37              |
| AYT FONDO EOLICO, FTA                   | -54,35            | 446                      | -404                 | 0                     | 1,67                          | 5,62                             | 0,00              |
| AYT FTPYME II, FTA                      | -68,13            | 1.082                    | -382                 | -453                  | 3,10                          | 1,65                             | 1,45              |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO II, FTH          | -11,94            | 2.344                    | -906                 | -1.261                | 2,31                          | 1,18                             | 1,13              |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO III, FTH         | -32,88            | 2.947                    | -929                 | -1.820                | 2,35                          | 1,36                             | 0,99              |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, FTH          | -63,09            | 2.881                    | -932                 | -1.705                | 2,30                          | 1,15                             | 1,15              |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH          | -46,75            | 6.443                    | -1.815               | -3.931                | 2,31                          | 1,26                             | 1,05              |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH          | -72,64            | 3.104                    | -976                 | -1.937                | 2,29                          | 1,27                             | 1,02              |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH         | -52,26            | 7.442                    | -2.121               | -4.456                | 2,31                          | 1,02                             | 1,29              |

| FONDO                                  | %Variación MI (1) | INT DCHOS CREDITO (2) | INT OBLIGACIONES (3) | RESULTADO DEL SWAP | TIPO INT DCHOS CREDITO (4) | TIPO INTERÉS OBLIGACIONES (5) | EXCESO SPREAD (%) |
|--|-------------------|-----------------------|----------------------|--------------------|----------------------------|-------------------------------|-------------------|
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH       | -50,76            | 11.041                | -3.188               | -6.691             | 2,34                       | 1,13                          | 1,21              |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH          | -51,03            | 6.714                 | -2.217               | -3.783             | 2,26                       | 1,06                          | 1,20              |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH         | -54,78            | 8.705                 | -2.675               | -5.297             | 2,25                       | 1,18                          | 1,07              |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH        | -219,91           | 5.799                 | -2.165               | -4.905             | 2,27                       | 1,17                          | 1,10              |
| AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA          | -52,75            | 37.059                | -22.531              | -11.878            | 2,31                       | 1,71                          | 0,60              |
| AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA           | 7,57              | 11.922                | -7.077               | -3.368             | 2,33                       | 1,92                          | 0,41              |
| AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA            | -20,08            | 14.960                | -7.970               | -6.222             | 2,35                       | 1,20                          | 1,15              |
| AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA             | -65,89            | 6.563                 | -2.502               | -2.863             | 2,81                       | 1,72                          | 1,09              |
| AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA            | -15,24            | 8.079                 | -3.054               | -3.189             | 2,72                       | 1,69                          | 1,03              |
| AYT HIPOTECARIO III, FTH               | -7,07             | 1.230                 | -323                 | 0                  | 2,12                       | 1,20                          | 0,92              |
| AYT HIPOTECARIO IV, FTH                | -6,24             | 1.369                 | -285                 | -197               | 3,99                       | 1,23                          | 2,76              |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FTA          | -11,51            | 2.502                 | -610                 | -1.146             | 3,40                       | 1,22                          | 0,00              |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA         | -47,06            | 2.378                 | -418                 | -1.115             | 3,55                       | 1,08                          | 2,47              |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, FTA          | -49,77            | 1.907                 | -478                 | -986               | 2,75                       | 1,29                          | 1,46              |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA           | -68,66            | 5.169                 | -1.065               | -3.417             | 3,13                       | 1,05                          | 2,08              |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO, FTA             | -16,90            | 1.601                 | -365                 | -51                | 3,68                       | 1,28                          | 2,40              |
| AYT ICO-FTVPO CAIXA GALICIA I, FTA     | -1,74             | 2.113                 | -527                 | -1.473             | 2,96                       | 1,45                          | 1,51              |
| AYT ICO-FTVPO CAJA MURCIA, FTA         | -61,28            | 1.862                 | -474                 | -1.134             | 2,93                       | 1,46                          | 1,47              |
| AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA    | -47,50            | 1.235                 | -578                 | -426               | 2,43                       | 1,62                          | 0,81              |
| AYT ICO-FTVPO I, FTA                   | -85,37            | 3.586                 | -966                 | -2.571             | 2,93                       | 1,47                          | 1,46              |
| AYT ICO-FTVPO III, FTA                 | -54,06            | 3.017                 | -792                 | -1.750             | 2,93                       | 1,49                          | 0,00              |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA           | -74,68            | 4.690                 | -1.281               | -2.785             | 2,45                       | 1,21                          | 1,24              |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA          | -24,47            | 14.669                | -2.227               | -9.016             | 3,14                       | 1,21                          | 1,93              |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO IV, FTA          | -37,10            | 23.877                | -10.214              | -9.512             | 3,02                       | 2,11                          | 0,91              |
| AYT PRESTAMOS CONSUMO III, FTA         | -126,11           | 920                   | -212                 | -879               | 5,75                       | 2,80                          | 2,95              |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS II, FTA  | -96,42            | 639                   | -179                 | -438               | 3,21                       | 1,15                          | 2,06              |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS III, FTA | -50,57            | 1.003                 | -288                 | -585               | 2,82                       | 1,20                          | 1,62              |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS IV, FTA  | -162,17           | 777                   | -170                 | -939               | 3,82                       | 1,35                          | 2,46              |
| AYT SA NOSTRA FINANCIACION I, FTA      | -86,87            | 753                   | -165                 | -329               | 9,67                       | 2,56                          | 7,11              |

| FONDO                                   | %Variación MI (1) | INT DCHOS CREDITO<br>(2) | INT OBLIGACIONES (3) | RESULTADO DEL<br>SWAP | TIPO INT DCHOS<br>CREDITO (4) | TIPO INTERÉS<br>OBLIGACIONES (5) | EXCESO SPREAD (%) |
|---|-------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------------|----------------------------------|-------------------|
| AYT UNICAJA FINANCIACION I, FTA         | -62,15            | 6.130                    | -1.149               | -2.813                | 7,15                          | 2,26                             | 4,89              |
| AYT VPO II, FTA                         | -71,57            | 1.881                    | -486                 | -1.221                | 2,98                          | 1,50                             | 1,48              |
| AYT.1, FTH                              | 2,76              | 617                      | -207                 | 0                     | 3,50                          | 1,87                             | 1,63              |
| AYT.11, FTH                             | 4,07              | 1.612                    | -489                 | -100                  | 3,40                          | 1,83                             | 1,57              |
| AYT.2, FTH                              | -30,62            | 254                      | -109                 | 0                     | 2,98                          | 1,89                             | 1,09              |
| AYT.7, PROMOCIONES INMOBILIARIAS I, FTA | -20,23            | 436                      | -164                 | 0                     | 3,09                          | 1,77                             | 1,32              |
| BANCAJA - BVA VPO 1, FTA                | -53,35            | 4.684                    | -1.208               | -2.730                | 2,79                          | 1,13                             | 1,66              |
| BANCAJA 10, FTA                         | -62,03            | 19.246                   | -5.453               | -10.020               | 2,62                          | 1,02                             | 1,60              |
| BANCAJA 11, FTA                         | -58,28            | 16.345                   | -4.866               | -8.520                | 2,60                          | 1,06                             | 1,54              |
| BANCAJA 13, FTA                         | -62,88            | 28.162                   | -9.549               | -13.793               | 2,54                          | 1,13                             | 1,41              |
| BANCAJA 3, FTA                          | -60,37            | 2.218                    | -925                 | -840                  | 2,90                          | 1,41                             | 1,49              |
| BANCAJA 4, FTH                          | -57,00            | 2.349                    | -669                 | -1.256                | 2,79                          | 1,07                             | 1,72              |
| BANCAJA 5, FTA                          | -56,65            | 2.665                    | -773                 | -1.341                | 2,74                          | 1,08                             | 1,66              |
| BANCAJA 6, FTA                          | -55,86            | 5.988                    | -1.834               | -2.907                | 2,73                          | 1,11                             | 1,62              |
| BANCAJA 7, FTA                          | -55,88            | 6.991                    | -1.931               | -3.553                | 2,65                          | 1,02                             | 1,63              |
| BANCAJA 8, FTA                          | -59,19            | 7.464                    | -2.341               | -3.490                | 2,63                          | 1,06                             | 1,58              |
| BANCAJA 9, FTA                          | -60,14            | 11.288                   | -3.509               | -5.673                | 2,64                          | 1,08                             | 1,56              |
| BANCAJA LEASING 1, FTA                  | -42,13            | 6.359                    | -2.173               | 0                     | 2,98                          | 1,24                             | 1,74              |
| BANKINTER 10, FTA                       | -44,76            | 7.909                    | -2.976               | -4.211                | 2,31                          | 1,10                             | 1,21              |
| BANKINTER 11, FTH                       | -51,56            | 4.725                    | -1.711               | -2.703                | 2,24                          | 1,06                             | 1,18              |
| BANKINTER 12, FTH                       | -48,59            | 6.476                    | -2.130               | -3.509                | 2,28                          | 1,01                             | 1,27              |
| BANKINTER 13 FTA                        | -45,51            | 9.956                    | -3.305               | -5.602                | 2,31                          | 1,04                             | 1,27              |
| BANKINTER 2 PYME FTA                    | -61,84            | 2.460                    | -1.077               | -1.196                | 2,50                          | 1,25                             | 1,24              |
| BANKINTER 2, FTH                        | -23,50            | 382                      | -216                 | 0                     | 2,47                          | 1,49                             | 0,98              |
| BANKINTER 3 FTPYME FTA                  | -82,98            | 2.771                    | -1.258               | -1.449                | 2,34                          | 1,24                             | 1,10              |
| BANKINTER 3, FTH                        | -59,16            | 2.651                    | -941                 | -1.360                | 2,45                          | 1,11                             | 1,34              |
| BANKINTER 4 FTPYME, FTA                 | -40,71            | 2.249                    | -784                 | -1.114                | 2,38                          | 1,13                             | 1,25              |
| BANKINTER 4, FTH                        | -55,64            | 2.729                    | -897                 | -1.490                | 2,37                          | 1,05                             | 1,32              |
| BANKINTER 5, FTH                        | -53,88            | 1.991                    | -620                 | -1.056                | 2,45                          | 1,04                             | 1,41              |



| FONDO                     | %Variación MI (1) | INT DCHOS CREDITO<br>(2) | INT OBLIGACIONES (3) | RESULTADO DEL<br>SWAP | TIPO INT DCHOS<br>CREDITO (4) | TIPO INTERÉS<br>OBLIGACIONES (5) | EXCESO SPREAD (%) |
|---------------------------|-------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------------|----------------------------------|-------------------|
| BANKINTER 6, FTA          | -54,14            | 4.738                    | -1.571               | -2.480                | 2,40                          | 1,07                             | 1,33              |
| BANKINTER 7, FTH          | -54,36            | 1.765                    | -555                 | -922                  | 2,42                          | 1,03                             | 1,38              |
| BANKINTER 8, FTA          | -55,35            | 3.934                    | -1.155               | -2.040                | 2,43                          | 0,99                             | 1,44              |
| BANKINTER 9, FTA          | -55,37            | 4.576                    | -1.274               | -2.438                | 2,32                          | 0,92                             | 1,41              |
| BBVA AUTOS 1 FTA          | -88,53            | 598                      | -66                  | -352                  | 7,62                          | 1,21                             | 6,41              |
| BBVA AUTOS 2 FTA          | -72,46            | 4.467                    | -376                 | -2.336                | 6,76                          | 0,96                             | 5,80              |
| BBVA CONSUMO 1, FTA       | -73,53            | 6.616                    | -454                 | -3.682                | 7,59                          | 0,92                             | 6,66              |
| BBVA CONSUMO 2, FTA       | -73,33            | 9.111                    | -743                 | -4.844                | 7,46                          | 1,00                             | 6,46              |
| BBVA CONSUMO 3 FTA        | -73,83            | 9.223                    | -991                 | -5.581                | 7,30                          | 1,23                             | 6,07              |
| BBVA CONSUMO 4 FTA        | -71,34            | 21.176                   | -2.559               | -14.464               | 8,26                          | 1,28                             | 6,99              |
| BBVA CONSUMO 5, FTA       | -64,75            | 28.099                   | -2.688               | -19.635               | 8,36                          | 1,12                             | 7,25              |
| BBVA EMPRESAS 1, FTA      | -61,17            | 2.440                    | -1.096               | -859                  | 2,45                          | 1,31                             | 1,15              |
| BBVA EMPRESAS 2, FTA      | -59,03            | 10.123                   | -4.484               | -2.793                | 2,33                          | 1,24                             | 1,08              |
| BBVA EMPRESAS 3, FTA      | -750,82           | 10.806                   | -3.887               | -4.127                | 3,00                          | 1,27                             | 1,73              |
| BBVA EMPRESAS 4, FTA      | -86,70            | 8.476                    | -2.777               | -4.817                | 2,80                          | 1,13                             | 1,67              |
| BBVA EMPRESAS 5, FTA      | -64,44            | 8.943                    | -3.223               | -4.083                | 2,79                          | 1,18                             | 1,61              |
| BBVA EMPRESAS 6, FTA      | 209,36            | 14.738                   | -4.297               | -7.929                | 3,53                          | 1,20                             | 2,33              |
| BBVA FINANZIA AUTOS 1 FTA | -72,00            | 4.335                    | -440                 | -2.620                | 6,23                          | 1,01                             | 5,22              |
| BBVA HIPOTECARIO 3, FTA   | -32,78            | 3.004                    | -658                 | -1.339                | 3,10                          | 1,03                             | 2,07              |
| BBVA LEASING 1, FTA       | -56,62            | 4.222                    | -1.706               | -1.621                | 2,27                          | 1,10                             | 1,17              |
| BBVA RMBS 1, FTA          | -53,44            | 19.478                   | -5.053               | -9.118                | 2,62                          | 0,97                             | 1,65              |
| BBVA RMBS 10, FTA         | -9,16             | 19.031                   | -5.726               | -10.044               | 2,64                          | 1,08                             | 1,56              |
| BBVA RMBS 11, FTA         | 0,00              | 20.036                   | -6.407               | 0                     | 2,95                          | 0,92                             | 2,02              |
| BBVA RMBS 2, FTA          | -53,84            | 38.546                   | -9.800               | -18.212               | 2,62                          | 0,96                             | 1,66              |
| BBVA RMBS 3, FTA          | -47,99            | 29.317                   | -7.399               | -15.370               | 2,85                          | 1,01                             | 1,84              |
| BBVA RMBS 5 FTA           | -51,63            | 51.749                   | -14.045              | -30.460               | 2,95                          | 1,13                             | 1,82              |
| BBVA RMBS 9, FTA          | -51,63            | 16.830                   | -4.381               | -9.934                | 2,97                          | 1,08                             | 1,89              |
| BBVA-3 FTPYME FTA         | -65,56            | 1.198                    | -158                 | -885                  | 3,89                          | 0,99                             | 2,90              |
| BBVA-4 PYME, FTA          | 121,43            | 1.818                    | -252                 | -357                  | 3,80                          | 1,12                             | 2,68              |

| FONDO                                 | %Variación MI (1) | INT DCHOS CREDITO<br>(2) | INT OBLIGACIONES (3) | RESULTADO DEL<br>SWAP | TIPO INT DCHOS<br>CREDITO (4) | TIPO INTERÉS<br>OBLIGACIONES (5) | EXCESO SPREAD (%) |
|---------------------------------------|-------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------------|----------------------------------|-------------------|
| BBVA-5 FTPYME, FTA                    | -59,11            | 2.475                    | -535                 | -991                  | 2,77                          | 0,91                             | 1,86              |
| BBVA-6 FTPYME FTA                     | -69,52            | 2.523                    | -812                 | -1.000                | 2,43                          | 1,01                             | 1,41              |
| BBVA-7 FTGENCAT, FTA                  | -68,79            | 566                      | -200                 | -268                  | 2,58                          | 1,13                             | 1,45              |
| BBVA-8 FTPYME FTA                     | -84,21            | 2.797                    | -1.341               | -1.138                | 2,47                          | 1,28                             | 1,19              |
| BBVA-9 PYME FTA                       | 0,00              | 408                      | -28                  | 0                     | 3,99                          | 0,28                             | 3,72              |
| BCL MUNICIPIOS I FTA                  | -57,86            | 565                      | -392                 | -106                  | 1,43                          | 1,08                             | 0,34              |
| CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA              | -54,63            | 7.926                    | -1.479               | -4.205                | 3,18                          | 0,79                             | 2,39              |
| CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA              | -61,35            | 6.562                    | -1.645               | -3.205                | 3,17                          | 0,98                             | 2,18              |
| CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA    | -88,70            | 3.480                    | -1.389               | -1.770                | 3,14                          | 1,40                             | 1,74              |
| CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA        | -65,12            | 3.305                    | -857                 | -1.525                | 3,17                          | 0,97                             | 2,20              |
| CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA            | 77,03             | 2.437                    | -826                 | 0                     | 2,41                          | 0,99                             | 1,42              |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, FTA    | -50,00            | 42.560                   | -42.500              | 0                     | 4,26                          | 4,25                             | 0,01              |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 5, FTA    | -23,91            | 52.945                   | -52.875              | 0                     | 4,51                          | 4,50                             | 0,01              |
| CEDULAS TDA 15, FTA                   | 0,00              | 25.829                   | -25.829              | 0                     | 3,25                          | 3,25                             | 0,00              |
| CEDULAS TDA 17, FTA                   | 0,00              | 24.702                   | -24.702              | 0                     | 3,13                          | 3,13                             | 0,00              |
| CEDULAS TDA 18, FTA                   | -12.600,00        | 16.810                   | -16.685              | 0                     | 3,50                          | 3,50                             | 0,00              |
| CEDULAS TDA 2, FTA                    | -49,16            | 45.562                   | -45.471              | 0                     | 4,51                          | 4,50                             | 0,01              |
| CEDULAS TDA 21, FONDO DE TITULIZACION | 0,00              | 60.668                   | -60.668              | 0                     | 4,25                          | 4,25                             | 0,00              |
| CEDULAS TDA 3, FTA                    | -48,99            | 44.332                   | -44.231              | 0                     | 4,39                          | 4,38                             | 0,01              |
| CEDULAS TDA 5, FTA                    | 0,00              | 31.121                   | -31.121              | 0                     | 4,13                          | 4,13                             | 0,00              |
| CEDULAS TDA 6, FTA                    | 0,00              | 58.603                   | -58.603              | 0                     | 3,88                          | 3,88                             | 0,00              |
| CEDULAS TDA 7, FTA                    | -100,00           | 35.288                   | -35.288              | 0                     | 3,50                          | 3,50                             | 0,00              |
| CIBELES III FTPYME, FTA               | -35,57            | 468                      | -441                 | -152                  | 2,46                          | 2,16                             | 0,30              |
| CM BANCAJA 1, FTA                     | -46,71            | 814                      | -808                 | -443                  | 2,60                          | 2,04                             | 0,56              |
| CONSUMO BANCAJA 1, FTA                | -86,35            | 944                      | -386                 | -358                  | 6,41                          | 2,00                             | 4,42              |
| DRIVER ESPAÑA ONE, FTA                | -63,35            | 7.797                    | -2.552               | -2.738                | 4,49                          | 1,75                             | 2,74              |
| EDT FTPYME PASTOR 3, FTA              | -89,48            | 556                      | -284                 | -97                   | 2,86                          | 1,75                             | 1,11              |
| EMPRESAS BANESTO 2, FTA               | -108,36           | 6.387                    | -2.376               | -3.892                | 3,00                          | 1,00                             | 1,20              |
| EMPRESAS BANESTO 5, FTA               | -87,10            | 9.868                    | -5.609               | -3.499                | 2,00                          | 1,00                             | 0,91              |

| FONDO   | %Variación MI (1) | INT DCHOS CREDITO<br>(2) | INT OBLIGACIONES (3) | RESULTADO DEL<br>SWAP | TIPO INT DCHOS<br>CREDITO (4) | TIPO INTERÉS<br>OBLIGACIONES (5) | EXCESO SPREAD (%) |
|---|-------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------------|----------------------------------|-------------------|
| EMPRESAS BANESTO 6, FTA                                       | -103,33           | 10.167                   | -6.672               | -3.659                | 3,00                          | 1,00                             | 2,04              |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 3, FTA                           | -87,15            | 2.503                    | -776                 | -1.574                | 2,90                          | 0,92                             | 1,98              |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 5, FTA                           | -17,06            | 8.618                    | -3.088               | -4.514                | 2,83                          | 1,22                             | 1,61              |
| FTA PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZ. DE<br>CED. HIPOTECARIA | -48,02            | 31.249                   | -31.065              | 0                     | 5,00                          | 5,00                             | 0,01              |
| FINANCAT 1, FTA   | -81,66            | 4.324                    | -1.685               | -1.770                | 7,03                          | 1,83                             | 5,20              |
| FINANCIACION BANESTO 1, FTA                                   | -83,33            | 1.668                    | -170                 | -1.117                | 8,00                          | 0,00                             | 7,88              |
| FONCAIXA AUTONOMOS 1, FTA                                     | -61,33            | 15.179                   | -7.711               | -4.176                | 3,01                          | 1,38                             | 1,62              |
| FONCAIXA CONSUMO 1, FTA                                       | -14,44            | 54.923                   | -28.687              | -14.136               | 4,00                          | 1,87                             | 2,13              |
| FONCAIXA EMPRESAS 3, FTA                                      | -76,15            | 14.651                   | -10.235              | -1.359                | 2,79                          | 1,49                             | 1,30              |
| FONCAIXA FTGENCAT 3, FTA                                      | -56,49            | 2.436                    | -675                 | -1.362                | 2,74                          | 0,51                             | 2,23              |
| FONCAIXA FTGENCAT 4, FTA                                      | -52,46            | 3.064                    | -673                 | -1.869                | 2,78                          | 0,43                             | 2,35              |
| FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA                                      | -71,86            | 7.590                    | -2.126               | -4.762                | 2,72                          | 0,55                             | 2,16              |
| FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA                                      | -68,78            | 5.653                    | -2.129               | -2.964                | 2,76                          | 0,78                             | 1,97              |
| FONCAIXA LEASINGS 1, FTA                                      | -7,20             | 14.913                   | -10.208              | -386                  | 2,50                          | 1,30                             | 1,20              |
| FONCAIXA PYMES 3, FTA   | 0,00              | 6.967                    | -1.457               | 0                     | 3,97                          | 0,61                             | 3,37              |
| FTA FTPYME SANTANDER 1  | -74,03            | 3.899                    | -1.550               | -1.511                | 3,00                          | 3,00                             | 2,00              |
| FTA FTPYME SANTANDER 2  | -61,73            | 4.741                    | -1.603               | -2.007                | 2,00                          | 2,00                             | 1,00              |
| FTA PYMES SANTANDER 3   | 0,00              | 28.516                   | -5.835               | 0                     | 2,00                          | 1,00                             | 1,70              |
| FTA PYMES SANTANDER 4   | 0,00              | 16.571                   | -2.236               | 0                     | 5,00                          | 1,00                             | 4,68              |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 07-1                        | -81,24            | 7.383                    | -1.698               | -4.099                | 7,00                          | 7,00                             | 6,00              |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2011-1                      | 41,86             | 23.031                   | -7.002               | -11.088               | 8,00                          | 2,00                             | 5,93              |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2012-1                      | 0,00              | 5.871                    | -1.381               | 0                     | 8,00                          | 8,00                             | 1,00              |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 10, FTA                                | 19,20             | 45.340                   | -20.570              | -23.007               | 5,00                          | 1,00                             | 3,80              |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 2                                      | -85,17            | 3.682                    | -1.729               | -1.392                | 2,00                          | 1,00                             | 0,91              |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 4                                      | -70,41            | 9.890                    | -4.854               | -2.445                | 2,00                          | 0,00                             | 1,73              |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 8, FTA                                 | -88,78            | 38.879                   | -28.852              | -4.234                | 3,00                          | 1,00                             | 1,92              |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 9, FTA                                 | -92,11            | 35.150                   | -23.089              | -9.307                | 4,00                          | 1,00                             | 2,61              |

| FONDO   | %Variación MI (1) | INT DCHOS CREDITO<br>(2) | INT OBLIGACIONES (3) | RESULTADO DEL<br>SWAP | TIPO INT DCHOS<br>CREDITO (4) | TIPO INTERÉS<br>OBLIGACIONES (5) | EXCESO SPREAD (%) |
|---|-------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------------|----------------------------------|-------------------|
| FTA SANTANDER FINANCIACION 1                                    | -69,01            | 2.875                    | -1.196               | 56                    | 2,00                          | 1,00                             | 0,99              |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 5                                    | -31,69            | 34.932                   | -9.433               | -13.527               | 8,00                          | 1,00                             | 7,14              |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2                                     | -70,96            | 11.415                   | -3.085               | -6.198                | 2,00                          | 0,00                             | 1,59              |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3                                     | -34,93            | 20.320                   | -5.321               | -6.936                | 2,00                          | 2,00                             | 1,00              |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 6                                     | -55,12            | 8.830                    | -5.281               | -2.005                | 2,00                          | 1,00                             | 0,81              |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 7                                     | 5,88              | 18.135                   | -11.769              | -2.371                | 2,00                          | 2,00                             | 1,00              |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 8                                     | 1.232,46          | 9.320                    | -4.980               | -2.821                | 3,00                          | 1,00                             | 1,17              |
| FTA SANTANDER PUBLICO 1   | -8,30             | 2.211                    | -739                 | -1.207                | 1,00                          | 1,00                             | 1,00              |
| FTA UCI 11  | -19,12            | 4.126                    | -809                 | 0                     | 3,00                          | 1,00                             | 1,69              |
| FTA UCI 14  | -41,40            | 11.078                   | -1.944               | 0                     | 3,00                          | 1,00                             | 2,20              |
| FTA UCI 16  | -46,42            | 17.501                   | -3.620               | 0                     | 4,00                          | 1,00                             | 2,91              |
| FTA UCI 18  | -44,40            | 17.707                   | -4.713               | -4.183                | 3,00                          | 1,00                             | 2,40              |
| FTA UCI 6   | -26,51            | 729                      | -194                 | 0                     | 3,00                          | 1,00                             | 2,50              |
| FTA UCI 7   | -24,52            | 894                      | -229                 | 0                     | 3,00                          | 0,00                             | 2,80              |
| FTA UCI 8   | -22,88            | 1.257                    | -293                 | 0                     | 3,00                          | 0,00                             | 2,19              |
| FTA UCI 9   | -23,57            | 3.287                    | -878                 | 0                     | 3,00                          | 0,00                             | 2,62              |
| FTA, HIPOTEBANSA 11   | -10,94            | 3.213                    | -795                 | -1.116                | 2,00                          | 0,00                             | 1,72              |
| FTA, HIPOTEBANSA X  | -23,73            | 2.106                    | -484                 | -854                  | 2,00                          | 0,00                             | 2,01              |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 1                                       | -78,08            | 4.146                    | -1.459               | -1.862                | 2,00                          | 1,00                             | 1,45              |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 3                                       | -67,47            | 8.444                    | -3.105               | -3.726                | 2,00                          | 1,00                             | 1,38              |
| FTA, UCI 15   | -38,91            | 12.141                   | -2.341               | 0                     | 3,00                          | 1,00                             | 2,11              |
| FTA, UCI 17   | -42,57            | 15.237                   | -3.115               | -3.805                | 4,00                          | 0,00                             | 3,10              |
| FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL<br>SISTEMA ELECTRICO, FTA | -45,33            | 359.772                  | -345.591             | 0                     | 5,40                          | 5,04                             | 0,36              |
| FTH UCI 10  | -16,56            | 2.420                    | -551                 | 0                     | 3,00                          | 3,00                             | 1,00              |
| FTH UCI 12  | -22,02            | 5.897                    | -1.075               | 0                     | 3,00                          | 1,00                             | 1,85              |
| FTH UCI 5   | -21,47            | 338                      | -82                  | 0                     | 3,00                          | 0,00                             | 2,75              |
| FTPYME BANCAJA 2 FTA  | -72,97            | 490                      | -155                 | -275                  | 2,75                          | 1,20                             | 1,55              |
| FTPYME BANCAJA 3 FTA  | -63,62            | 671                      | -267                 | -201                  | 2,58                          | 1,24                             | 1,34              |

| FONDO                              | %Variación MI (1) | INT DCHOS CREDITO<br>(2) | INT OBLIGACIONES (3) | RESULTADO DEL<br>SWAP | TIPO INT DCHOS<br>CREDITO (4) | TIPO INTERÉS<br>OBLIGACIONES (5) | EXCESO SPREAD (%) |
|------------------------------------|-------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------------|----------------------------------|-------------------|
| FTPYME BANCAJA 6 FTA               | -181,48           | 1.864                    | -1.383               | -1.044                | 2,34                          | 1,63                             | 0,71              |
| FTPYME TDA 6, FTA                  | -76,88            | 330                      | -73                  | -220                  | 3,08                          | 0,90                             | 2,18              |
| FTPYME TDA 7, FTA                  | -685,71           | 1.061                    | -622                 | -644                  | 3,03                          | 1,57                             | 1,45              |
| FTPYME TDA CAM 2, FTA              | -80,40            | 1.049                    | -246                 | -675                  | 2,89                          | 0,82                             | 2,07              |
| FTPYME TDA CAM 4, FTA              | -3.059,46         | 4.785                    | -1.861               | -4.019                | 2,85                          | 1,16                             | 1,69              |
| FTPYME TDA CAM 7, FTA              | -71,46            | 6.245                    | -2.459               | -3.091                | 2,65                          | 1,16                             | 1,48              |
| FTPYME TDA CAM 9, FTA              | -61,28            | 6.392                    | -971                 | 0                     | 3,00                          | 1,00                             | 2,00              |
| GAT FTGENCAT 2005, FTA             | -66,45            | 1.010                    | -271                 | -531                  | 2,57                          | 0,60                             | 1,98              |
| GAT FTGENCAT 2006, FTA             | -50,70            | 1.089                    | -477                 | -542                  | 2,66                          | 0,94                             | 1,72              |
| GAT FTGENCAT 2007, FTA             | -83,38            | 2.424                    | -1.254               | -1.112                | 2,41                          | 1,04                             | 1,37              |
| GAT FTGENCAT 2008, FTA             | -69,21            | 3.837                    | -1.842               | -1.284                | 2,38                          | 0,99                             | 1,39              |
| GAT FTGENCAT 2009, FTA             | -54,59            | 4.418                    | -433                 | 0                     | 2,54                          | 0,60                             | 1,94              |
| GAT ICO-FTVPO 1, FTH               | -47,25            | 4.123                    | -1.646               | -2.237                | 3,22                          | 0,95                             | 2,27              |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 1, FTA  | -62,49            | 1.845                    | -366                 | -1.078                | 3,39                          | 0,40                             | 2,98              |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 2, FTA  | -67,59            | 1.993                    | -1.753               | -534                  | 3,47                          | 2,01                             | 1,46              |
| GC FTGENCAT CAIXA TARRAGONA 1, FTA | -120,14           | 1.793                    | -908                 | -1.001                | 2,54                          | 1,04                             | 1,50              |
| GC FTGENCAT SABADELL 1, FTA        | -68,71            | 1.610                    | -333                 | -905                  | 2,86                          | 0,34                             | 2,51              |
| GC FTPYME PASTOR 4, FTA            | 2,32              | 1.519                    | -442                 | -812                  | 3,48                          | 0,75                             | 2,73              |
| GC FTPYME SABADELL 4, FTA          | -64,00            | 1.869                    | -378                 | -1.171                | 3,13                          | 0,36                             | 2,76              |
| GC FTPYME SABADELL 5, FTA          | -64,11            | 3.289                    | -704                 | -1.963                | 2,85                          | 0,38                             | 2,48              |
| GC FTPYME SABADELL 6, FTA          | -63,20            | 3.784                    | -781                 | -2.313                | 3,01                          | 0,37                             | 2,64              |
| GC FTPYME SABADELL 8, FTA          | -59,59            | 9.003                    | -5.448               | -1.626                | 3,13                          | 1,62                             | 1,51              |
| GC FTPYME UNNIM 1, FTA             | 274,28            | 4.740                    | -2.755               | -952                  | 3,72                          | 2,13                             | 1,59              |
| GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA       | -40,83            | 6.354                    | -1.554               | -4.074                | 3,19                          | 0,47                             | 2,72              |
| GC SABADELL 1, FTH                 | -57,18            | 5.668                    | -1.175               | -3.539                | 2,96                          | 0,37                             | 2,59              |
| GC SABADELL EMPRESAS 2, FTA        | -65,90            | 3.908                    | -1.615               | -1.937                | 2,66                          | 0,90                             | 1,76              |
| GC SABADELL EMPRESAS 4, FTA        | -64,86            | 3.384                    | -1.849               | -1.179                | 2,59                          | 1,16                             | 1,43              |
| HIPOCAT 10, FTA                    | -2,65             | 10.206                   | -2.713               | -5.071                | 2,81                          | 0,55                             | 2,26              |
| HIPOCAT 11, FTA                    | -49,11            | 10.954                   | -2.916               | -5.278                | 2,96                          | 0,54                             | 2,42              |

| FONDO                           | %Variación MI (1) | INT DCHOS CREDITO<br>(2) | INT OBLIGACIONES (3) | RESULTADO DEL<br>SWAP | TIPO INT DCHOS<br>CREDITO (4) | TIPO INTERÉS<br>OBLIGACIONES (5) | EXCESO SPREAD (%) |
|---------------------------------|-------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------------|----------------------------------|-------------------|
| HIPOCAT 14, FTA                 | -63,04            | 6.599                    | -2.474               | -3.153                | 3,07                          | 0,91                             | 2,16              |
| HIPOCAT 16, FTA                 | -58,20            | 8.066                    | -2.479               | -3.641                | 2,21                          | 0,52                             | 1,69              |
| HIPOCAT 17, FTA                 | -60,07            | 10.023                   | -2.671               | -4.726                | 2,21                          | 0,56                             | 1,65              |
| HIPOCAT 18, FTA                 | 29,02             | 7.811                    | -2.413               | 0                     | 2,19                          | 0,57                             | 1,62              |
| HIPOCAT 19, FTA                 | -29,41            | 8.510                    | -912                 | 0                     | 2,58                          | 0,45                             | 2,13              |
| HIPOCAT 20, FTA                 | -29,30            | 11.601                   | -1.201               | 0                     | 2,77                          | 0,44                             | 2,33              |
| HIPOCAT 4, FTA                  | -56,90            | 1.140                    | -225                 | -715                  | 3,96                          | 0,53                             | 3,43              |
| HIPOCAT 5, FTA                  | -54,20            | 2.916                    | -510                 | -1.871                | 3,96                          | 0,49                             | 3,47              |
| HIPOCAT 6, FTA                  | -50,80            | 4.204                    | -831                 | -2.541                | 3,66                          | 0,52                             | 3,14              |
| HIPOCAT 7, FTA                  | -47,81            | 7.532                    | -1.445               | -4.205                | 3,13                          | 0,43                             | 2,70              |
| HIPOCAT 8, FTA                  | -58,93            | 9.126                    | -1.746               | -5.437                | 3,03                          | 0,35                             | 2,68              |
| HIPOCAT 9, FTA                  | -45,48            | 6.445                    | -1.661               | -3.270                | 2,65                          | 0,52                             | 2,13              |
| ICO MEDIACION I AYT, FTA        | -42,51            | 3.753                    | -1.530               | -1.267                | 2,48                          | 1,79                             | 0,69              |
| ICO MEDIACION II AYT FTA        | -63,62            | 71.621                   | -34.347              | 23.008                | 2,26                          | 2,66                             | -0,40             |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 1, FTA  | -61,50            | 3.834                    | -658                 | -2.560                | 4,01                          | 0,49                             | 3,44              |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 2, FTA  | -60,93            | 7.279                    | -1.895               | -4.569                | 4,07                          | 0,76                             | 3,28              |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 3, FTA  | 182,86            | 19.987                   | -4.461               | 0                     | 4,21                          | 0,85                             | 3,34              |
| IM BANCO POPULAR MBS 2, FTA     | -51,42            | 9.486                    | -2.724               | -4.724                | 3,26                          | 0,67                             | 2,58              |
| IM BANKOA MBS 1, FTA            | -58,28            | 4.427                    | -1.594               | -2.032                | 1,84                          | 0,53                             | 1,30              |
| IM BCG RMBS 1, FTA              | -51,36            | 3.294                    | -1.260               | -1.496                | 1,58                          | 0,49                             | 1,09              |
| IM BES EMPRESAS 1, FTA          | 531,32            | 9.733                    | -1.065               | 0                     | 3,02                          | 0,48                             | 2,55              |
| IM CAJA LABORAL 1, FTA          | -71,87            | 4.967                    | -1.563               | -2.700                | 1,82                          | 0,46                             | 1,36              |
| IM CAJA LABORAL 2, FTA          | -76,26            | 5.134                    | -1.912               | -2.808                | 1,72                          | 0,58                             | 1,13              |
| IM CAJA LABORAL EMPRESAS 1, FTA | -22,80            | 3.487                    | -497                 | 0                     | 1,63                          | 0,41                             | 1,21              |
| IM CAJAMAR 1, FTA               | -43,65            | 1.860                    | -448                 | -968                  | 3,02                          | 0,51                             | 2,49              |
| IM CAJAMAR 3, FTA               | -59,77            | 8.819                    | -1.833               | -5.371                | 3,04                          | 0,36                             | 2,66              |
| IM CAJAMAR 4, FTA               | -59,63            | 8.657                    | -1.981               | -5.312                | 3,03                          | 0,42                             | 2,60              |
| IM CAJAMAR 5, FTA               | -55,77            | 10.452                   | -2.570               | -6.284                | 3,13                          | 0,49                             | 2,62              |
| IM CAJAMAR 6, FTA               | -57,28            | 22.189                   | -6.470               | -13.969               | 3,19                          | 0,63                             | 2,54              |

| FONDO                                  | %Variación MI (1) | INT DCHOS CREDITO<br>(2) | INT OBLIGACIONES (3) | RESULTADO DEL<br>SWAP | TIPO INT DCHOS<br>CREDITO (4) | TIPO INTERÉS<br>OBLIGACIONES (5) | EXCESO SPREAD (%) |
|--|-------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------------|----------------------------------|-------------------|
| IM CAJAMAR EMPRESAS 2 FTPYME, FTA      | -46,15            | 2.653                    | -1.012               | -1.060                | 3,29                          | 1,07                             | 2,16              |
| IM CAJAMAR EMPRESAS 4, FTA             | 0,00              | 18.113                   | -2.886               | 0                     | 3,84                          | 0,51                             | 3,33              |
| IM CAJASTUR MBS 1, FTA                 | -14,16            | 6.366                    | -1.473               | -3.159                | 1,94                          | 0,48                             | 1,46              |
| IM CEDULAS 1 GRUPO BANCO POPULAR, FTA  | -49,71            | 42.586                   | -42.500              | 0                     | 4,26                          | 4,25                             | 0,01              |
| IM CEDULAS 10, FTA                     | -50,00            | 29.315                   | -29.250              | 0                     | 4,51                          | 4,50                             | 0,01              |
| IM CEDULAS 14, FTA                     | -50,41            | 19.560                   | -19.500              | 0                     | 3,26                          | 3,25                             | 0,01              |
| IM CEDULAS 15, FTA                     | -70,63            | 18.386                   | -18.339              | 0                     | 3,86                          | 3,85                             | 0,01              |
| IM CEDULAS 2, FTA                      | -49,32            | 33.262                   | -33.187              | 0                     | 4,51                          | 4,50                             | 0,01              |
| IM CEDULAS 3, FTA                      | -50,00            | 21.253                   | -21.200              | 0                     | 4,01                          | 4,00                             | 0,01              |
| IM CEDULAS 4, FTA                      | -50,48            | 39.010                   | -38.907              | 0                     | 3,76                          | 3,75                             | 0,01              |
| IM CEDULAS 5, FTA                      | -50,40            | 21.937                   | -21.875              | 0                     | 3,51                          | 3,50                             | 0,01              |
| IM CEDULAS 7, FTA                      | -50,40            | 25.062                   | -25.000              | 0                     | 4,01                          | 4,00                             | 0,01              |
| IM CEDULAS 9, FTA                      | -50,39            | 27.157                   | -27.094              | 0                     | 4,26                          | 4,25                             | 0,01              |
| IM CFS RMBS 1, FTA                     | 0,00              | 447                      | -30                  | 0                     | 2,94                          | 0,41                             | 2,53              |
| IM CITI TARJETAS 1, FTA                | 0,00              | 41.444                   | -2.640               | 0                     | 23,83                         | 3,16                             | 0,00              |
| IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA            | -60,50            | 2.794                    | -482                 | -1.727                | 2,91                          | 0,31                             | 2,57              |
| IM FTGENCAT SABADELL 3, FTA            | -76,06            | 1.383                    | -491                 | -739                  | 3,30                          | 0,82                             | 2,38              |
| IM FTGENCAT SABADELL 4, FTA            | -67,56            | 2.694                    | -1.155               | -1.286                | 3,31                          | 1,13                             | 2,11              |
| IM FTPYME SABADELL 3, FTA              | -3,93             | 1.496                    | -191                 | -743                  | 3,10                          | 0,37                             | 2,73              |
| IM FTPYME SABADELL 7, FTA              | -51,82            | 5.525                    | -2.220               | -2.591                | 3,09                          | 0,96                             | 2,09              |
| IM FTPYME SABADELL 9, FTA              | 175,03            | 22.073                   | -6.468               | 0                     | 3,43                          | 0,84                             | 2,58              |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, FTA | -58,78            | 6.320                    | -1.719               | -2.076                | 3,96                          | 0,79                             | 3,08              |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 3, FTA | -34,94            | 13.667                   | -23.017              | 13.493                | 3,85                          | 2,02                             | 1,74              |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 4, FTA | -56,80            | 23.224                   | -9.543               | 0                     | 3,83                          | 1,21                             | 2,54              |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I FTA    | -57,78            | 8.203                    | -1.976               | -2.868                | 3,84                          | 0,62                             | 3,11              |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME II, FTA  | 76,72             | 5.232                    | -1.719               | -3.308                | 3,60                          | 0,87                             | 2,54              |
| IM GRUPO BANCO POPULAR LEASING 2, FTA  | -46,17            | 17.298                   | -11.511              | 0                     | 3,71                          | 1,07                             | 2,63              |
| IM PASTOR 2, FTH                       | -51,00            | 3.806                    | -1.018               | -2.271                | 2,52                          | 0,48                             | 2,03              |
| IM PASTOR 3, FTH                       | -27,63            | 5.189                    | -1.091               | -3.480                | 3,19                          | 0,35                             | 2,75              |

| FONDO                                | %Variación MI (1) | INT DCHOS CREDITO<br>(2) | INT OBLIGACIONES (3) | RESULTADO DEL<br>SWAP | TIPO INT DCHOS<br>CREDITO (4) | TIPO INTERÉS<br>OBLIGACIONES (5) | EXCESO SPREAD (%) |
|--------------------------------------|-------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------------|----------------------------------|-------------------|
| IM PASTOR 4, FTA                     | -46,68            | 6.343                    | -1.350               | -3.048                | 3,05                          | 0,36                             | 2,61              |
| IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, FTA     | -39,81            | 1.616                    | -584                 | -1.156                | 1,46                          | 0,40                             | 1,42              |
| IM SABADELL EMPRESAS 1, FTA          | -62,26            | 3.041                    | -1.307               | -1.223                | 2,95                          | 1,09                             | 1,84              |
| IM SABADELL EMPRESAS 3, FTA          | -126,67           | 8.765                    | -3.997               | -4.425                | 2,66                          | 1,01                             | 1,59              |
| IM SABADELL EMPRESAS 5, FTA          | -1,59             | 3.940                    | -2.244               | -1.262                | 3,40                          | 1,63                             | 1,41              |
| IM SABADELL RMBS 2, FTA              | -55,85            | 13.044                   | -3.969               | -7.232                | 3,00                          | 0,70                             | 2,30              |
| IM SABADELL RMBS 3, FTA              | -53,63            | 15.620                   | -4.175               | -10.066               | 3,25                          | 0,60                             | 2,64              |
| IM TERRASSA 1 FTGENCAT FTA           | -28,83            | 842                      | -212                 | -393                  | 2,82                          | 0,62                             | 2,21              |
| IM TERRASSA MBS 1, FTA               | -55,48            | 3.004                    | -705                 | -1.738                | 2,56                          | 0,42                             | 2,14              |
| INTERMONEY MASTER CEDULAS, FTA       | -50,00            | 29.046                   | -28.963              | 0                     | 3,51                          | 3,50                             | 0,01              |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS III, FTA | 142,89            | 3.306                    | -1.566               | 18.017                | 2,03                          | 1,51                             | 0,52              |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS IV, FTA  | -70,33            | 7.954                    | -3.437               | 247                   | 3,01                          | 2,98                             | 0,03              |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS V, FTA   | 52,84             | 20.026                   | -4.522               | -3.795                | 3,54                          | 2,19                             | 1,35              |
| MADRID CONSUMO I, FTA                | -78,82            | 5.652                    | -539                 | -1.396                | 7,12                          | 1,06                             | 6,05              |
| MADRID FTPYME I, FTA                 | -66,92            | 7.299                    | -5.191               | 4.679                 | 2,53                          | 2,56                             | -0,03             |
| MADRID FTPYME II, FTA                | -14.495,35        | 12.609                   | -4.917               | -1.502                | 3,75                          | 2,64                             | 1,11              |
| MADRID ICO-FTVPO I, FTA              | -69,35            | 1.977                    | -713                 | -769                  | 2,41                          | 1,11                             | 1,30              |
| MADRID RESIDENCIAL I, FTA            | -67,30            | 5.759                    | -1.646               | -2.150                | 2,39                          | 1,06                             | 1,33              |
| MADRID RESIDENCIAL II, FTA           | -66,62            | 5.128                    | -1.614               | -1.714                | 2,37                          | 1,06                             | 1,31              |
| MADRID RMBS I, FTA                   | -74,36            | 10.589                   | -3.186               | -5.476                | 2,60                          | 0,89                             | 1,71              |
| MADRID RMBS II, FTA                  | -63,34            | 9.314                    | -2.865               | -4.190                | 2,60                          | 0,90                             | 1,70              |
| MADRID RMBS III FTA                  | -50,56            | 17.802                   | -5.939               | -6.755                | 2,61                          | 0,96                             | 1,65              |
| MADRID RMBS IV, FTA                  | -76,33            | 12.802                   | -5.515               | -6.018                | 2,44                          | 1,08                             | 1,36              |
| MBS BANCAJA 1 FTA                    | -59,47            | 1.518                    | -385                 | -840                  | 2,83                          | 1,00                             | 1,83              |
| MBS BANCAJA 2, FTA                   | -65,15            | 3.164                    | -1.072               | -1.572                | 2,69                          | 1,16                             | 1,53              |
| MBS BANCAJA 3, FTA                   | -60,42            | 4.244                    | -1.279               | -2.146                | 2,68                          | 1,05                             | 1,63              |
| MBS BANCAJA 4, FTA                   | -60,78            | 12.040                   | -3.371               | -6.071                | 2,64                          | 1,01                             | 1,62              |
| MBS BANCAJA 6, FTA                   | 1,22              | 9.336                    | -3.218               | 0                     | 2,63                          | 1,18                             | 1,45              |
| MBS BANCAJA 7, FTA                   | 8,28              | 10.006                   | -3.688               | 0                     | 2,68                          | 1,27                             | 1,41              |



| FONDO                                     | %Variación MI (1) | INT DCHOS CREDITO<br>(2) | INT OBLIGACIONES (3) | RESULTADO DEL<br>SWAP | TIPO INT DCHOS<br>CREDITO (4) | TIPO INTERÉS<br>OBLIGACIONES (5) | EXCESO SPREAD (%) |
|---|-------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------------|----------------------------------|-------------------|
| MBS BANCAJA 8, FTA                        | -10,78            | 5.256                    | -1.930               | 0                     | 2,70                          | 1,25                             | 1,45              |
| MBSCAT 1, FTA                             | -56,13            | 10.474                   | -2.321               | -5.588                | 2,77                          | 0,63                             | 2,14              |
| MBSCAT 2, FTA                             | -45,30            | 5.280                    | -355                 | 0                     | 2,68                          | 0,48                             | 2,20              |
| PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA                 | 0,00              | 184.969                  | -184.969             | 0                     | 3,57                          | 3,57                             | 0,00              |
| PYME BANCAJA 5, FTA                       | -62,09            | 1.585                    | -1.080               | -864                  | 2,55                          | 1,72                             | 0,83              |
| PYME BANCAJA 7, FTA                       | 61,37             | 4.169                    | -2.252               | -2.293                | 2,36                          | 1,52                             | 0,84              |
| PYME VALENCIA 1, FTA                      | -58,07            | 2.321                    | -1.384               | -550                  | 2,20                          | 1,66                             | 0,54              |
| PYME VALENCIA 2, FTA                      | -27,71            | 2.517                    | -1.004               | 0                     | 2,84                          | 1,34                             | 1,50              |
| PYMECAT 2 FTPYME, FTA                     | -68,43            | 1.897                    | -896                 | -732                  | 2,21                          | 0,85                             | 1,36              |
| PYMECAT 3 FTPYME, FTA                     | -62,31            | 6.284                    | -1.078               | 0                     | 3,23                          | 0,79                             | 2,44              |
| PYMES BANESTO 2, FTA                      | -151,48           | 2.815                    | -838                 | -2.324                | 3,00                          | 1,00                             | 1,84              |
| RURAL CEDULA I, FTA                       | 0,00              | 20.256                   | -20.201              | 0                     | 4,03                          | 3,96                             | 0,06              |
| RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA           | -58,47            | 6.518                    | -1.743               | -4.032                | 3,07                          | 1,10                             | 1,97              |
| RURAL HIPOTECARIO II FTH                  | -32,30            | 405                      | -99                  | 0                     | 3,38                          | 1,14                             | 2,24              |
| RURAL HIPOTECARIO III FTH                 | -22,93            | 898                      | -199                 | 0                     | 3,33                          | 1,06                             | 2,27              |
| RURAL HIPOTECARIO IV FTH                  | -15,39            | 1.677                    | -385                 | 0                     | 3,25                          | 1,06                             | 2,19              |
| RURAL HIPOTECARIO IX, FTA                 | -55,84            | 12.819                   | -3.024               | -7.593                | 2,98                          | 1,01                             | 1,97              |
| RURAL HIPOTECARIO V FTA                   | -22,58            | 2.494                    | -708                 | 0                     | 2,80                          | 1,07                             | 1,73              |
| RURAL HIPOTECARIO VI, FTA                 | -57,01            | 4.697                    | -998                 | -2.834                | 3,08                          | 0,97                             | 2,11              |
| RURAL HIPOTECARIO VII, FTA                | -56,19            | 6.498                    | -1.264               | -4.083                | 3,13                          | 0,93                             | 2,20              |
| RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA               | -51,17            | 9.613                    | -2.129               | -5.708                | 3,06                          | 0,99                             | 2,07              |
| RURAL HIPOTECARIO X, FTA                  | -62,31            | 19.427                   | -4.846               | -12.099               | 3,08                          | 1,09                             | 1,99              |
| RURAL HIPOTECARIO XI, FTA                 | -60,40            | 23.969                   | -6.360               | -14.495               | 3,00                          | 1,10                             | 1,90              |
| RURAL HIPOTECARIO XII, FTA                | -54,69            | 9.977                    | -2.923               | -5.452                | 2,83                          | 1,11                             | 1,73              |
| RURALPYME 1 FTPYME FTA                    | -100,00           | 394                      | -179                 | -215                  | 3,51                          | 1,71                             | 1,79              |
| RURALPYME 2 FTPYME FTA                    | 62,36             | 2.681                    | -961                 | -1.155                | 3,63                          | 1,51                             | 2,12              |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN 09-1, FTA        | -64,62            | 7.401                    | -1.892               | -4.210                | 8,00                          | 2,00                             | 6,77              |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2010-1, FTA | -66,14            | 11.473                   | -2.546               | -6.140                | 8,00                          | 1,00                             | 7,04              |

| FONDO                        | %Variación MI (1) | INT DCHOS CREDITO<br>(2) | INT OBLIGACIONES (3) | RESULTADO DEL<br>SWAP | TIPO INT DCHOS<br>CREDITO (4) | TIPO INTERÉS<br>OBLIGACIONES (5) | EXCESO SPREAD (%) |
|------------------------------|-------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------------|----------------------------------|-------------------|
| SANTANDER HIPOTECARIO I, FTA | -69,03            | 7.920                    | -2.144               | -4.247                | 2,00                          | 0,00                             | 1,27              |
| SOL-LION, FTA                | -60,00            | 27.836                   | -13.425              | -8.243                | 2,03                          | 1,05                             | 0,99              |
| TDA 11, FTH                  | -15,24            | 934                      | -233                 | 0                     | 3,36                          | 1,02                             | 2,34              |
| TDA 12, FTH                  | -36,02            | 973                      | -211                 | 0                     | 3,77                          | 1,00                             | 2,77              |
| TDA 13 - MIXTO, FTA          | -16,07            | 908                      | -208                 | 0                     | 3,48                          | 0,98                             | 0,00              |
| TDA 14 - MIXTO, FTA          | -28,55            | 1.990                    | -413                 | 0                     | 3,86                          | 1,00                             | 0,00              |
| TDA 15 - MIXTO, FTA          | -10,64            | 1.645                    | -419                 | 0                     | 3,17                          | 1,01                             | 0,00              |
| TDA 16 - MIXTO, FTA          | -26,91            | 1.763                    | -446                 | 0                     | 3,35                          | 1,03                             | 0,00              |
| TDA 17 - MIXTO, FTA          | -36,97            | 1.618                    | -343                 | 0                     | 3,75                          | 1,00                             | 0,00              |
| TDA 18 - MIXTO, FTA          | -16,18            | 1.554                    | -456                 | 0                     | 2,91                          | 1,04                             | 0,00              |
| TDA 19 - MIXTO, FTA          | -30,16            | 2.736                    | -739                 | -955                  | 3,14                          | 1,05                             | 2,09              |
| TDA 20 - MIXTO, FTA          | -33,43            | 1.867                    | -434                 | -758                  | 2,91                          | 0,85                             | 0,00              |
| TDA 22 - MIXTO, FTA          | -16,04            | 2.659                    | -772                 | -1.238                | 3,28                          | 1,12                             | 0,00              |
| TDA 23, FTA                  | -74,25            | 4.646                    | -839                 | -3.268                | 3,30                          | 0,80                             | 2,50              |
| TDA 24, FTA                  | -46,07            | 3.180                    | -719                 | -1.974                | 3,48                          | 0,91                             | 2,57              |
| TDA 25, FTA                  | -67,71            | 1.933                    | -505                 | -1.139                | 3,81                          | 0,90                             | 2,91              |
| TDA 26 - MIXTO, FTA          | -63,78            | 5.178                    | -1.196               | -3.221                | 3,00                          | 0,85                             | 0,00              |
| TDA 27, FTA                  | -64,46            | 6.666                    | -1.784               | -4.066                | 3,08                          | 0,91                             | 2,18              |
| TDA 28, FTA                  | 2,45              | 3.689                    | -1.217               | -2.138                | 3,39                          | 0,94                             | 2,45              |
| TDA 29, FTA                  | -40,97            | 6.080                    | -1.568               | -3.446                | 2,85                          | 0,91                             | 1,95              |
| TDA 30, FTA                  | -65,05            | 3.514                    | -1.224               | -1.916                | 2,88                          | 1,11                             | 1,77              |
| TDA 31, FTA                  | -59,29            | 2.569                    | -726                 | -1.350                | 3,04                          | 1,03                             | 2,01              |
| TDA CAJAMAR 2, FTA           | -54,22            | 5.785                    | -1.308               | -3.256                | 3,10                          | 0,90                             | 2,20              |
| TDA CAM 1, FTA               | -49,74            | 3.709                    | -869                 | -2.061                | 3,18                          | 0,97                             | 2,21              |
| TDA CAM 10, FTA              | -74,04            | 9.847                    | -3.359               | -5.537                | 2,86                          | 1,09                             | 1,77              |
| TDA CAM 11, FTA              | -517,21           | 16.673                   | -7.722               | -6.648                | 2,74                          | 1,43                             | 1,31              |
| TDA CAM 12, FTA              | -46,58            | 19.467                   | -9.042               | -7.800                | 2,72                          | 1,42                             | 1,30              |
| TDA CAM 2, FTA               | -59,72            | 4.019                    | -911                 | -2.447                | 3,10                          | 0,91                             | 2,19              |
| TDA CAM 3, FTA               | -59,17            | 4.569                    | -1.024               | -2.619                | 3,13                          | 0,91                             | 2,23              |

| FONDO                                   | %Variación MI (1) | INT DCHOS CREDITO<br>(2) | INT OBLIGACIONES (3) | RESULTADO DEL<br>SWAP | TIPO INT DCHOS<br>CREDITO (4) | TIPO INTERÉS<br>OBLIGACIONES (5) | EXCESO SPREAD (%) |
|---|-------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------------|----------------------------------|-------------------|
| TDA CAM 4, FTA                          | -62,85            | 10.420                   | -1.935               | -6.562                | 3,00                          | 0,77                             | 2,23              |
| TDA CAM 5, FTA                          | -64,02            | 12.986                   | -2.536               | -8.202                | 2,88                          | 0,76                             | 2,12              |
| TDA CAM 6, FTA                          | -62,37            | 8.879                    | -1.732               | -5.750                | 2,97                          | 0,76                             | 2,20              |
| TDA CAM 7, FTA                          | -62,37            | 12.907                   | -2.699               | -7.996                | 2,88                          | 0,81                             | 2,07              |
| TDA CAM 8, FTA                          | -65,91            | 12.904                   | -2.913               | -8.164                | 2,86                          | 0,84                             | 2,02              |
| TDA CAM 9, FTA                          | -66,91            | 11.727                   | -2.997               | -7.304                | 2,90                          | 0,90                             | 2,01              |
| TDA CORPORATIVOS I, FTA                 | 2,77              | 3.052                    | -2.998               | 652                   | 2,20                          | 1,86                             | 0,34              |
| TDA EMPRESAS 1, FTA                     | -95,09            | 721                      | -597                 | 0                     | 3,23                          | 2,17                             | 1,06              |
| TDA EMPRESAS 2, FTA                     | -82,01            | 1.192                    | -548                 | 0                     | 3,87                          | 1,74                             | 2,14              |
| TDA FTPYME PASTOR 9, FTA                | -50,62            | 4.906                    | -1.892               | 0                     | 3,73                          | 1,56                             | 2,17              |
| TDA IBERCAJA 1, FTA                     | -65,38            | 2.495                    | -643                 | -1.449                | 3,01                          | 0,95                             | 2,06              |
| TDA IBERCAJA 2, FTA                     | -63,22            | 4.845                    | -1.210               | -2.695                | 2,61                          | 0,80                             | 1,80              |
| TDA IBERCAJA 3, FTA                     | -64,40            | 5.368                    | -1.617               | -2.886                | 2,43                          | 0,85                             | 1,58              |
| TDA IBERCAJA 4, FTA                     | -66,32            | 7.892                    | -2.401               | -4.373                | 2,41                          | 0,87                             | 1,54              |
| TDA IBERCAJA 5, FTA                     | -66,18            | 7.584                    | -2.251               | -4.179                | 2,39                          | 0,85                             | 1,54              |
| TDA IBERCAJA 6, FTA                     | -91,46            | 10.688                   | -4.480               | -6.080                | 2,36                          | 1,06                             | 1,30              |
| TDA IBERCAJA 7, FTA                     | -74,30            | 16.135                   | -7.229               | -8.019                | 2,22                          | 1,05                             | 1,17              |
| TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH             | -88,14            | 5.215                    | -1.992               | -3.258                | 2,97                          | 1,34                             | 1,63              |
| TDA LICO LEASING III, FTA               | 0,00              | 1.732                    | -433                 | 0                     | 5,32                          | 2,44                             | 2,88              |
| TDA PASTOR 1, FTA                       | -43,70            | 1.688                    | -392                 | -791                  | 2,90                          | 1,00                             | 1,90              |
| TDA PASTOR CONSUMO 1, FTA               | -71,83            | 1.095                    | -147                 | -777                  | 7,35                          | 0,89                             | 6,46              |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA           | -22,58            | 691                      | -395                 | -416                  | 2,53                          | 1,45                             | 1,09              |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA           | -113,19           | 1.584                    | -821                 | -811                  | 2,66                          | 1,39                             | 1,27              |
| TDA TARRAGONA 1, FTA                    | -103,77           | 3.975                    | -1.512               | -2.490                | 3,27                          | 1,31                             | 1,97              |
| UNICAJA ANDALUCIA FTVIVIENDA TDA 1, FTA | -63,49            | 2.275                    | -555                 | -1.433                | 2,96                          | 0,92                             | 2,04              |
| UNICAJA AYT EMPRESAS I, FTA             | -60,56            | 1.929                    | -609                 | -536                  | 3,28                          | 1,69                             | 1,59              |
| UNICAJA TDA VPO, FTA                    | -26,10            | 2.265                    | -589                 | -1.373                | 2,95                          | 0,97                             | 1,98              |
| VAL BANCAJA 1, FTA                      | 26,66             | 2.956                    | -1.008               | 0                     | 2,49                          | 1,14                             | 1,35              |
| VALENCIA HIPOTECARIO 1, FTA             | -55,62            | 1.882                    | -435                 | -1.072                | 2,94                          | 1,00                             | 1,94              |

| FONDO                          | %Variación MI (1) | INT DCHOS CREDITO<br>(2) | INT OBLIGACIONES (3) | RESULTADO DEL<br>SWAP | TIPO INT DCHOS<br>CREDITO (4) | TIPO INTERÉS<br>OBLIGACIONES (5) | EXCESO SPREAD (%) |
|--------------------------------|-------------------|--------------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------------|----------------------------------|-------------------|
| VALENCIA HIPOTECARIO 2, FTH    | -50,84            | 5.130                    | -1.354               | -2.454                | 2,70                          | 0,99                             | 1,71              |
| VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA    | -50,98            | 6.066                    | -1.698               | -2.913                | 2,63                          | 1,01                             | 1,62              |
| VALENCIA HIPOTECARIO 4, FTA    | -40,18            | 7.420                    | -3.483               | -3.544                | 2,51                          | 1,34                             | 1,16              |
| VALENCIA HIPOTECARIO 5, FTA    | -61,83            | 4.529                    | -1.482               | -2.216                | 2,51                          | 1,11                             | 1,40              |
| <b>Subtotal BONOS 2012 2</b>   | <b>-52,36</b>     | <b>5.149.140</b>         | <b>-3.281.715</b>    | <b>-1.016.987</b>     | <b>3,34</b>                   | <b>2,22</b>                      | <b>1,06</b>       |
| <b>Subtotal BONOS 2011 2</b>   | <b>0,00</b>       | <b>6.690.025</b>         | <b>-5.412.528</b>    | <b>-422.091</b>       | <b>3,22</b>                   | <b>2,45</b>                      | <b>0,79</b>       |
| <b>%Variación</b>              | <b>-</b>          | <b>-23,03</b>            | <b>-39,37</b>        | <b>140,94</b>         | <b>3,73</b>                   | <b>-9,39</b>                     | <b>34,18</b>      |
| <b>PAGARÉS</b>                 |                   |                          |                      |                       |                               |                                  |                   |
| FTA SANTANDER 2                | -14,45            | 28.471                   | -10.834              | 0                     | 0,00                          | 0,00                             | 0,00              |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2012 2</b> | <b>-45,20</b>     | <b>28.471</b>            | <b>-10.834</b>       | <b>0</b>              | <b>0,00</b>                   | <b>0,00</b>                      | <b>0,00</b>       |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2011 2</b> | <b>0,00</b>       | <b>35.510</b>            | <b>-17.280</b>       | <b>0</b>              | <b>0</b>                      | <b>0</b>                         | <b>0,04</b>       |
| <b>%Variación</b>              | <b>-</b>          | <b>-19,82</b>            | <b>-37,30</b>        | <b>-</b>              | <b>-100,00</b>                | <b>-100,00</b>                   | <b>-100,00</b>    |
| <b>Total 2012 2</b>            | <b>-52,23</b>     | <b>5.177.611</b>         | <b>-3.292.549</b>    | <b>-1.016.987</b>     | <b>3,32</b>                   | <b>2,21</b>                      | <b>1,06</b>       |
| <b>Total 2011 2</b>            | <b>0,00</b>       | <b>6.725.535</b>         | <b>-5.429.808</b>    | <b>-422.091</b>       | <b>3,21</b>                   | <b>2,44</b>                      | <b>0,79</b>       |
| <b>%Variación</b>              | <b>-</b>          | <b>-23,02</b>            | <b>-39,36</b>        | <b>140,94</b>         | <b>3,43</b>                   | <b>-9,43</b>                     | <b>34,18</b>      |

Nota: Importes en miles de euros

(1) Porcentaje de variación interanual del importe de los intereses devengados por los derechos de créditos menos los devengados por los valores emitidos, más los rendimientos generados por las operaciones de cobertura de flujos de efectivo.

(2) Importe de intereses de derechos de crédito

(3) Importe de intereses de obligaciones y otros valores negociables.

(4) Tipo de interés interanual medio ponderado de los activos

(5) Tipo de interés interanual medio ponderado de los pasivos emitidos

| FONDO                                   | COMISIÓN GESTORA | IMPORTE DEVENGADO | COMISIÓN VARIABLE             |                   |                       |
|---|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------------|
|   |                  |                   | IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR |                   |                       |
|   |                  |                   | RTDO REALIZADO                | RTDO NO REALIZADO | PDAS REPERCUTIDAS (1) |
| <b>BONOS</b>                            |                  |                   |                               |                   |                       |
| AUTO ABS 2012-3, FTA                    | -114             | -4.078            | 4.078                         | 0                 | 0                     |
| AYT ANDALUCIA FTEMPRESA CAJAMAR, FTA    | -36              | 0                 | 63                            | 0                 | -64                   |
| AYT CAIXA GALICIA EMPRESAS I, FTA       | -27              | 0                 | 0                             | 0                 | -42                   |
| AYT CAIXA SABADELL HIPOTECARIO I, FTA   | -50              | 0                 | 116                           | 0                 | -119                  |
| AYT CAIXANOVA FTPYME I, FTA             | -12              | 0                 | 0                             | 0                 | -2                    |
| AYT CAIXANOVA HIPOTECARIO I, FTA        | -36              | -766              | 766                           | 0                 | 0                     |
| AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA              | -40              | -6.692            | 1.486                         | 0                 | 0                     |
| AYT CAJA MURCIA HIPOTECARIO I, FTA      | -18              | -398              | 266                           | 0                 | 0                     |
| AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA      | -24              | 0                 | 634                           | 0                 | -635                  |
| AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FTA      | -17              | -521              | 623                           | 0                 | 0                     |
| AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA            | 0                | -999              | 368                           | 0                 | -7                    |
| AYT CEDULAS CAJAS IV, FTA               | 0                | 0                 | 353                           | 0                 | -112                  |
| AYT CEDULAS CAJAS IX, FTA               | 0                | 0                 | 301                           | 0                 | -5                    |
| AYT CEDULAS CAJAS V, FTA                | 0                | 0                 | 295                           | 0                 | -295                  |
| AYT CEDULAS CAJAS VI, FTA               | 0                | -4                | 306                           | 0                 | 0                     |
| AYT CEDULAS CAJAS VIII, FTA             | 0                | 0                 | 246                           | 0                 | -246                  |
| AYT CEDULAS CAJAS X, FTA                | 0                | -39               | 1.183                         | 0                 | 0                     |
| AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FTA    | -94              | 0                 | 138                           | 0                 | -149                  |
| AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA | -647             | -936              | 14.638                        | 0                 | -7.378                |
| AYT DEUDA SUBORDINADA I, FTA            | -31              | -588              | 1.562                         | -1.562            | 0                     |
| AYT FONDO EOLICO, FTA                   | 0                | -42               | 21                            | 0                 | -2                    |
| AYT FTPYME II, FTA                      | -19              | 0                 | 1.302                         | 0                 | -1.304                |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO II, FTH          | -26              | 0                 | 0                             | 0                 | -1                    |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO III, FTH         | -28              | 0                 | 585                           | 0                 | -591                  |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, FTH          | -32              | -190              | 603                           | 0                 | -74                   |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH          | -62              | 0                 | 1.602                         | 0                 | -1.615                |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH          | -27              | 0                 | 682                           | 0                 | -125                  |

| FONDO                                  | COMISIÓN GESTORA | IMPORTE DEVENGADO | COMISIÓN VARIABLE             |                   |                       |
|--|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------------|
|  |                  |                   | IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR |                   |                       |
|  |                  |                   | RTDO REALIZADO                | RTDO NO REALIZADO | PDAS REPERCUTIDAS (1) |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH        | -74              | 0                 | 2.364                         | 0                 | -690                  |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH       | -109             | 0                 | 1.851                         | 0                 | -562                  |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH          | -70              | 0                 | 2.101                         | 0                 | -2.104                |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH         | -66              | 0                 | 447                           | 0                 | -457                  |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH        | -59              | 0                 | 0                             | 0                 | -2                    |
| AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA          | -1               | -1.703            | 7.142                         | 0                 | -6.445                |
| AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA           | -101             | 0                 | 0                             | 0                 | -34                   |
| AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA            | -88              | 0                 | 0                             | 0                 | -39                   |
| AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA             | -62              | -582              | 0                             | 0                 | -9                    |
| AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA            | -72              | -782              | 1.345                         | 0                 | -213                  |
| AYT HIPOTECARIO III, FTH               | -19              | -916              | 272                           | 0                 | 0                     |
| AYT HIPOTECARIO IV, FTH                | -19              | -850              | 287                           | 0                 | 0                     |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FTA          | -20              | -694              | 387                           | 0                 | -6                    |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA         | -19              | 0                 | 6.422                         | 0                 | -6.422                |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, FTA          | -20              | -205              | 113                           | 0                 | 0                     |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA           | -45              | -48               | 887                           | 0                 | -500                  |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO, FTA             | -19              | -331              | 0                             | 0                 | 0                     |
| AYT ICO FTVPO CAIXA GALICIA I, FTA     | -18              | 0                 | 0                             | 0                 | -2                    |
| AYT ICO-FTVPO CAJA MURCIA, FTA         | -17              | -72               | 246                           | 0                 | 0                     |
| AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA    | -18              | 0                 | 0                             | 0                 | -2                    |
| AYT ICO-FTVPO I, FTA                   | -32              | 0                 | 0                             | 0                 | -5                    |
| AYT ICO-FTVPO III, FTA                 | -33              | -188              | 17                            | 0                 | -6                    |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA           | -56              | -107              | 598                           | 0                 | -52                   |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA          | -66              | 0                 | 1.807                         | 0                 | -1.824                |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO IV, FTA          | -119             | 0                 | 0                             | 0                 | -72                   |
| AYT PRESTAMOS CONSUMO III, FTA         | -19              | 0                 | 0                             | 0                 | -1                    |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS II, FTA  | -19              | 0                 | 0                             | 22                | 0                     |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS III, FTA | -18              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |

| FONDO                                   | COMISIÓN GESTORA | IMPORTE DEVENGADO | COMISIÓN VARIABLE             |                   |         |                       |
|---|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|---------|-----------------------|
|   |                  |                   | IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR |                   |         | PDAS REPERCUTIDAS (1) |
|   |                  |                   | RTDO REALIZADO                | RTDO NO REALIZADO |         |                       |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS IV, FTA   | -18              | 0                 | 0                             | 0                 | -1      |                       |
| AYT SA NOSTRA FINANCIACION I, FTA       | -5               | -80               | 0                             | 0                 | 0       |                       |
| AYT UNICAJA FINANCIACION I, FTA         | -22              | 0                 | 0                             | 0                 | -3      |                       |
| AYT VPO II, FTA                         | -20              | 0                 | 0                             | 0                 | -2      |                       |
| AYT.1, FTH                              | -24              | -141              | 1.113                         | 0                 | -630    |                       |
| AYT.11, FTH                             | -21              | -825              | 536                           | 0                 | 0       |                       |
| AYT.2, FTH                              | -26              | -73               | 195                           | 0                 | 0       |                       |
| AYT.7, PROMOCIONES INMOBILIARIAS I, FTA | -20              | 0                 | 363                           | 0                 | -363    |                       |
| BANCAJA - BVA VPO 1, FTA                | -25              | -531              | 702                           | 0                 | 0       |                       |
| BANCAJA 10, FTA                         | -98              | 0                 | 25.028                        | 0                 | -17.432 |                       |
| BANCAJA 11, FTA                         | -75              | 0                 | 11.510                        | 0                 | -12.154 |                       |
| BANCAJA 13, FTA                         | -101             | 0                 | 7.289                         | 0                 | -3.067  |                       |
| BANCAJA 3, FTA                          | -22              | -411              | 63                            | 0                 | 0       |                       |
| BANCAJA 4, FTH                          | -22              | -373              | 60                            | 0                 | 0       |                       |
| BANCAJA 5, FTA                          | -25              | -483              | 1.385                         | 0                 | 0       |                       |
| BANCAJA 6, FTA                          | -56              | -1.067            | 3.568                         | 0                 | 0       |                       |
| BANCAJA 7, FTA                          | -57              | -1.323            | 3.964                         | 0                 | 0       |                       |
| BANCAJA 8, FTA                          | -59              | -780              | 9.662                         | 0                 | 0       |                       |
| BANCAJA 9, FTA                          | -75              | 0                 | 18.208                        | 0                 | -8.814  |                       |
| BANCAJA LEASING 1, FTA                  | -35              | 0                 | 0                             | 0                 | -27     |                       |
| BANKINTER 10, FTA                       | -75              | -460              | 2.633                         | 0                 | 0       |                       |
| BANKINTER 11, FTH                       | -45              | -232              | 1.035                         | 0                 | 0       |                       |
| BANKINTER 12, FTH                       | -58              | -562              | 5.494                         | 0                 | 0       |                       |
| BANKINTER 13 FTA                        | -76              | 0                 | 5.266                         | 0                 | -506    |                       |
| BANKINTER 2 PYME FTA                    | -21              | 0                 | 433                           | 0                 | -534    |                       |
| BANKINTER 2, FTH                        | -11              | -157              | 209                           | 0                 | 0       |                       |
| BANKINTER 3 FTPYME FTA                  | -22              | 0                 | 812                           | 0                 | -115    |                       |
| BANKINTER 3, FTH                        | -29              | -236              | 280                           | 0                 | 0       |                       |

| FONDO                     | COMISIÓN GESTORA | IMPORTE DEVENGADO | COMISIÓN VARIABLE             |                   |                       |
|---------------------------|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------------|
|                           |                  |                   | IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR |                   |                       |
|                           |                  |                   | RTDO REALIZADO                | RTDO NO REALIZADO | PDAS REPERCUTIDAS (1) |
| BANKINTER 4 FTPYME, FTA   | -17              | 0                 | 180                           | 0                 | -304                  |
| BANKINTER 4, FTH          | -31              | -271              | 192                           | 0                 | 0                     |
| BANKINTER 5, FTH          | -22              | -254              | 308                           | 0                 | 0                     |
| BANKINTER 6, FTA          | -52              | -550              | 1.287                         | 0                 | 0                     |
| BANKINTER 7, FTH          | -18              | -192              | 363                           | 0                 | 0                     |
| BANKINTER 8, FTA          | -39              | -538              | 1.330                         | 0                 | 0                     |
| BANKINTER 9, FTA          | -44              | -525              | 1.561                         | 0                 | 0                     |
| BBVA AUTOS 1 FTA          | -19              | 0                 | 3.238                         | 0                 | -3.237                |
| BBVA AUTOS 2 FTA          | -18              | 0                 | 12.679                        | 0                 | -12.259               |
| BBVA CONSUMO 1, FTA       | -16              | 0                 | 18.618                        | 0                 | -18.619               |
| BBVA CONSUMO 2, FTA       | -23              | 0                 | 19.865                        | 0                 | -19.864               |
| BBVA CONSUMO 3 FTA        | -18              | 0                 | 6.086                         | 0                 | -6.085                |
| BBVA CONSUMO 4 FTA        | -43              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| BBVA CONSUMO 5, FTA       | -55              | -667              | 0                             | 0                 | 0                     |
| BBVA EMPRESAS 1, FTA      | -17              | 0                 | 19                            | 0                 | -19                   |
| BBVA EMPRESAS 2, FTA      | -69              | 0                 | 416                           | 0                 | -416                  |
| BBVA EMPRESAS 3, FTA      | -60              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| BBVA EMPRESAS 4, FTA      | -52              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| BBVA EMPRESAS 5, FTA      | -56              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| BBVA EMPRESAS 6, FTA      | -69              | -658              | 0                             | 0                 | 0                     |
| BBVA FINANZIA AUTOS 1 FTA | -15              | 0                 | 8.401                         | 0                 | -8.561                |
| BBVA HIPOTECARIO 3, FTA   | -19              | -674              | 13.693                        | 0                 | 0                     |
| BBVA LEASING 1, FTA       | -36              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| BBVA RMBS 1, FTA          | -91              | 0                 | 15.149                        | 0                 | -15.148               |
| BBVA RMBS 10, FTA         | -73              | -2.508            | 1.545                         | 0                 | 0                     |
| BBVA RMBS 11, FTA         | -72              | -12.907           | 7.903                         | 0                 | 0                     |
| BBVA RMBS 2, FTA          | -136             | 0                 | 39.799                        | 0                 | -14.755               |
| BBVA RMBS 3, FTA          | -98              | 0                 | 20.314                        | 0                 | -20.313               |



| FONDO                                 | COMISIÓN GESTORA | IMPORTE DEVENGADO | COMISIÓN VARIABLE             |                   |                       |
|---------------------------------------|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------------|
|                                       |                  |                   | IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR |                   |                       |
|                                       |                  |                   | RTDO REALIZADO                | RTDO NO REALIZADO | PDAS REPERCUTIDAS (1) |
| BBVA RMBS 5 FTA                       | -141             | 0                 | 7.025                         | 0                 | -7.025                |
| BBVA RMBS 9, FTA                      | -70              | -965              | 3.430                         | 0                 | 0                     |
| BBVA-3 FTPYME FTA                     | -18              | 0                 | 1.481                         | 0                 | -196                  |
| BBVA-4 PYME, FTA                      | -17              | 0                 | 798                           | 0                 | -798                  |
| BBVA-5 FTPYME, FTA                    | -18              | 0                 | 2.221                         | 0                 | -2.220                |
| BBVA-6 FTPYME FTA                     | -20              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| BBVA-7 FTGENCAT, FTA                  | -5               | 0                 | 47                            | 0                 | -47                   |
| BBVA-8 FTPYME FTA                     | -21              | 0                 | 397                           | 0                 | -397                  |
| BBVA-9 PYME FTA                       | -2               | -374              | 374                           | 0                 | 0                     |
| BCL MUNICIPIOS I FTA                  | -28              | 28                | 126                           | 0                 | -92                   |
| CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA              | -39              | -1.971            | 2.382                         | 0                 | 0                     |
| CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA              | -28              | -1.544            | 2.000                         | 0                 | 0                     |
| CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA    | -19              | 0                 | 972                           | 0                 | -384                  |
| CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA        | -20              | -1.128            | 1.848                         | 0                 | 0                     |
| CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA            | -26              | -1.434            | 933                           | 0                 | 0                     |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, FTA    | -60              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 5, FTA    | -70              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| CEDULAS TDA 15, FTA                   | 0                | 0                 | 18                            | 0                 | 0                     |
| CEDULAS TDA 17, FTA                   | 0                | -6                | 399                           | 0                 | 0                     |
| CEDULAS TDA 18, FTA                   | 0                | -108              | 141                           | 0                 | 0                     |
| CEDULAS TDA 2, FTA                    | 0                | -39               | 205                           | 0                 | 0                     |
| CEDULAS TDA 21, FONDO DE TITULIZACION | 0                | 0                 | 8                             | 0                 | 0                     |
| CEDULAS TDA 3, FTA                    | 0                | -15               | 726                           | 0                 | 0                     |
| CEDULAS TDA 5, FTA                    | 0                | -4                | 118                           | 0                 | 0                     |
| CEDULAS TDA 6, FTA                    | 0                | -8                | 418                           | 0                 | 0                     |
| CEDULAS TDA 7, FTA                    | 0                | -7                | 481                           | 0                 | 0                     |
| CIBELES III FTPYME, FTA               | -9               | 0                 | 2.245                         | 0                 | -204                  |
| CM BANCAJA 1, FTA                     | -28              | 0                 | 585                           | 0                 | -662                  |

| FONDO  | COMISIÓN GESTORA | IMPORTE DEVENGADO | COMISIÓN VARIABLE             |                   |         |                       |
|--|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|---------|-----------------------|
|  |                  |                   | IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR |                   |         | PDAS REPERCUTIDAS (1) |
|  |                  |                   | RTDO REALIZADO                | RTDO NO REALIZADO |         |                       |
| CONSUMO BANCAJA 1, FTA                                     | -9               | 0                 | 4.923                         | 0                 | -4.998  |                       |
| DRIVER ESPAÑA ONE, FTA                                     | -42              | 0                 | 2.020                         | 0                 | -2.020  |                       |
| EDT FTPYME PASTOR 3, FTA                                   | -9               | 0                 | 164                           | 0                 | -207    |                       |
| EMPRESAS BANESTO 2, FTA                                    | -54              | -430              | 27.102                        | 0                 | -27.418 |                       |
| EMPRESAS BANESTO 5, FTA                                    | -76              | 550               | 4.410                         | 0                 | -4.554  |                       |
| EMPRESAS BANESTO 6, FTA                                    | -102             | 5.735             | 0                             | 0                 | -3      |                       |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 3, FTA                        | -24              | 0                 | 4.790                         | 0                 | -3.131  |                       |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 5, FTA                        | -46              | 0                 | 1.711                         | 0                 | -942    |                       |
| FTA PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZ. DE CED. HIPOTECARIA | -30              | 0                 | 0                             | 0                 | 0       |                       |
| FINANCAT 1, FTA  | -22              | 0                 | 3.679                         | 0                 | -3.679  |                       |
| FINANCIACION BANESTO 1, FTA                                | -30              | 771               | 21.729                        | 0                 | -22.065 |                       |
| FONCAIXA AUTONOMOS 1, FTA                                  | -70              | 0                 | 0                             | 0                 | -41     |                       |
| FONCAIXA CONSUMO 1, FTA                                    | -164             | -2.699            | 0                             | 0                 | -8      |                       |
| FONCAIXA EMPRESAS 3, FTA                                   | -96              | 0                 | 6.463                         | 0                 | -7.440  |                       |
| FONCAIXA FTGENCAT 3, FTA                                   | -27              | 239               | 0                             | 0                 | -9      |                       |
| FONCAIXA FTGENCAT 4, FTA                                   | -38              | 296               | 576                           | 0                 | -608    |                       |
| FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA                                   | -40              | 35                | 1.093                         | 0                 | -1.345  |                       |
| FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA                                   | -37              | 71                | 158                           | 0                 | -317    |                       |
| FONCAIXA LEASINGS 1, FTA                                   | -113             | 70                | 0                             | 0                 | -25     |                       |
| FONCAIXA PYMES 3, FTA                                      | -97              | -3.549            | 3.549                         | 0                 | 0       |                       |
| FTA FTPYME SANTANDER 1                                     | -34              | -321              | 3.577                         | 0                 | -408    |                       |
| FTA FTPYME SANTANDER 2                                     | -44              | -743              | 8.437                         | 0                 | -1.633  |                       |
| FTA PYMES SANTANDER 3                                      | -167             | -6.916            | 164                           | 0                 | -169    |                       |
| FTA PYMES SANTANDER 4                                      | -85              | -9.244            | 0                             | 0                 | -3      |                       |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 07-1                     | -26              | 5.335             | 27.223                        | 0                 | -27.223 |                       |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2011-1                   | -74              | -2.705            | 992                           | 0                 | 0       |                       |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2012-1                   | -9               | -3.359            | 3.359                         | 0                 | 0       |                       |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 10, FTA                             | -334             | 0                 | 0                             | 0                 | -9      |                       |

| FONDO  | COMISIÓN GESTORA | IMPORTE DEVENGADO | COMISIÓN VARIABLE             |                   |         |                       |
|--|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|---------|-----------------------|
|  |                  |                   | IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR |                   |         | PDAS REPERCUTIDAS (1) |
|  |                  |                   | RTDO REALIZADO                | RTDO NO REALIZADO |         |                       |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 2                                     | -40              | -88               | 22.382                        | 0                 | -22.469 |                       |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 4                                     | -89              | 0                 | 18.824                        | 0                 | -18.925 |                       |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 8, FTA                                | -413             | 24                | 0                             | 0                 | -29     |                       |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 9, FTA                                | -325             | 0                 | 6.720                         | 0                 | -6.739  |                       |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 1                                 | -33              | 0                 | 17.409                        | 0                 | -17.522 |                       |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 5                                 | -107             | -4.711            | 1.085                         | 0                 | -1.098  |                       |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2                                  | -121             | 913               | 10.439                        | 0                 | -10.557 |                       |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3                                  | -177             | 0                 | 0                             | 0                 | -119    |                       |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 6                                  | -103             | -566              | 0                             | 0                 | -87     |                       |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 7                                  | -194             | -4.239            | 3.693                         | 0                 | -3.694  |                       |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 8                                  | -89              | -328              | 0                             | 0                 | -3      |                       |
| FTA SANTANDER PUBLICO 1                                      | -40              | -298              | 5.041                         | 0                 | -4.837  |                       |
| FTA UCI 11   | -33              | -2.422            | 4.553                         | 0                 | 0       |                       |
| FTA UCI 14   | -60              | 0                 | 45.218                        | 0                 | 0       |                       |
| FTA UCI 16   | -76              | -9.097            | 75.924                        | 0                 | -14.526 |                       |
| FTA UCI 18   | -76              | -4.868            | 43.741                        | 0                 | 0       |                       |
| FTA UCI 6  | -20              | -343              | 73                            | 0                 | 0       |                       |
| FTA UCI 7  | -29              | -531              | 151                           | 0                 | 0       |                       |
| FTA UCI 8  | -29              | -753              | 260                           | 0                 | 0       |                       |
| FTA UCI 9  | -29              | -2.168            | 2.917                         | 0                 | 0       |                       |
| FTA, HIPOTEBANSA 11  | -38              | -666              | 963                           | 0                 | -11     |                       |
| FTA, HIPOTEBANSA X   | -39              | -551              | 325                           | 0                 | 0       |                       |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 1                                    | -45              | 1.112             | 9.411                         | 0                 | -9.451  |                       |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 3                                    | -72              | 2.082             | 18.961                        | 0                 | -19.062 |                       |
| FTA, UCI 15  | -75              | -3.381            | 54.512                        | 0                 | -460    |                       |
| FTA, UCI 17  | -76              | -205              | 31.062                        | 0                 | -4.675  |                       |
| FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA | -55              | -9.840            | 29.362                        | 0                 | 0       |                       |
| FTH UCI 10   | -29              | -1.736            | 1.988                         | 0                 | 0       |                       |

| FONDO                              | COMISIÓN GESTORA | IMPORTE DEVENGADO | COMISIÓN VARIABLE             |                   |        |                       |
|------------------------------------|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|--------|-----------------------|
|                                    |                  |                   | IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR |                   |        | PDAS REPERCUTIDAS (1) |
|                                    |                  |                   | RTDO REALIZADO                | RTDO NO REALIZADO |        |                       |
| FTH UCI 12                         | -39              | -3.222            | 12.789                        | 0                 | 0      |                       |
| FTH UCI 5                          | -6               | -175              | 91                            | 0                 | 0      |                       |
| FTPYME BANCAJA 2 FTA               | -15              | -2                | 702                           | 0                 | -14    |                       |
| FTPYME BANCAJA 3 FTA               | -16              | -46               | 1.784                         | 0                 | -13    |                       |
| FTPYME BANCAJA 6 FTA               | -21              | 0                 | 0                             | 0                 | -157   |                       |
| FTPYME TDA 6, FTA                  | -13              | -14               | 755                           | 0                 | 0      |                       |
| FTPYME TDA 7, FTA                  | -11              | 0                 | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| FTPYME TDA CAM 2, FTA              | -17              | 0                 | 5.024                         | 0                 | -710   |                       |
| FTPYME TDA CAM 4, FTA              | -31              | 0                 | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| FTPYME TDA CAM 7, FTA              | -36              | 0                 | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| FTPYME TDA CAM 9, FTA              | -44              | 0                 | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| GAT FTGENCAT 2005, FTA             | -15              | 0                 | 1.504                         | 0                 | -1.504 |                       |
| GAT FTGENCAT 2006, FTA             | -15              | 0                 | 715                           | 0                 | -715   |                       |
| GAT FTGENCAT 2007, FTA             | -20              | 0                 | 2.487                         | 0                 | -2.487 |                       |
| GAT FTGENCAT 2008, FTA             | -32              | 0                 | 1.414                         | 0                 | -1.414 |                       |
| GAT FTGENCAT 2009, FTA             | -18              | 0                 | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| GAT ICO-FTVPO 1, FTH               | -28              | -125              | 479                           | 0                 | -226   |                       |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 1, FTA  | -25              | 28                | 0                             | 0                 | -8     |                       |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 2, FTA  | -28              | 281               | 268                           | 0                 | -320   |                       |
| GC FTGENCAT CAIXA TARRAGONA 1, FTA | -24              | 5                 | 217                           | 0                 | -277   |                       |
| GC FTGENCAT SABADELL 1, FTA        | -16              | 1.314             | 667                           | 0                 | -736   |                       |
| GC FTPYME PASTOR 4, FTA            | -11              | 0                 | 0                             | 0                 | -89    |                       |
| GC FTPYME SABADELL 4, FTA          | -15              | 859               | 1.905                         | 0                 | -1.987 |                       |
| GC FTPYME SABADELL 5, FTA          | -20              | 2.941             | 553                           | 0                 | -708   |                       |
| GC FTPYME SABADELL 6, FTA          | -20              | 1.277             | 6.632                         | 0                 | -6.814 |                       |
| GC FTPYME SABADELL 8, FTA          | -39              | 0                 | 0                             | 0                 | -564   |                       |
| GC FTPYME UNNIM 1, FTA             | -37              | 0                 | 4                             | 0                 | -5     |                       |
| GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA       | -33              | 0                 | 2.521                         | 0                 | -2.854 |                       |

| FONDO                          | COMISIÓN GESTORA | IMPORTE DEVENGADO | COMISIÓN VARIABLE             |                   |                       |
|--------------------------------|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------------|
|                                |                  |                   | IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR |                   |                       |
|                                |                  |                   | RTDO REALIZADO                | RTDO NO REALIZADO | PDAS REPERCUTIDAS (1) |
| GC SABADELL 1, FTH             | -33              | -775              | 420                           | 0                 | 0                     |
| GC SABADELL EMPRESAS 2, FTA    | -21              | 789               | 2.214                         | 0                 | -2.392                |
| GC SABADELL EMPRESAS 4, FTA    | -20              | 0                 | 82                            | 0                 | -169                  |
| HIPOCAT 10, FTA                | -110             | 0                 | 6.631                         | 0                 | -6.631                |
| HIPOCAT 11, FTA                | -120             | 0                 | 8.613                         | 0                 | -8.613                |
| HIPOCAT 14, FTA                | -54              | -115              | 872                           | 0                 | 0                     |
| HIPOCAT 16, FTA                | -81              | -1.765            | 763                           | 0                 | 0                     |
| HIPOCAT 17, FTA                | -88              | -20               | 2.248                         | 0                 | -650                  |
| HIPOCAT 18, FTA                | -79              | -4.706            | 3.069                         | 0                 | 0                     |
| HIPOCAT 19, FTA                | -50              | -2.247            | 1.141                         | 0                 | 0                     |
| HIPOCAT 20, FTA                | -66              | -7.657            | 1.674                         | 0                 | 0                     |
| HIPOCAT 4, FTA                 | -27              | -131              | 3.373                         | 0                 | 0                     |
| HIPOCAT 5, FTA                 | -48              | -369              | 1.378                         | 0                 | 0                     |
| HIPOCAT 6, FTA                 | -71              | -604              | 13.224                        | 0                 | 0                     |
| HIPOCAT 7, FTA                 | -153             | -733              | 10.636                        | 0                 | -158                  |
| HIPOCAT 8, FTA                 | -119             | 0                 | 11.855                        | 0                 | -1.344                |
| HIPOCAT 9, FTA                 | -94              | 0                 | 3.144                         | 0                 | -2.712                |
| ICO MEDIACION I AYT, FTA       | 0                | 0                 | 238                           | 0                 | -231                  |
| ICO MEDIACION II AYT FTA       | -144             | -1.627            | 0                             | 0                 | 0                     |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 1, FTA | -10              | -736              | 10.329                        | 0                 | 0                     |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 2, FTA | -21              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 3, FTA | -49              | -10.718           | 20.866                        | 0                 | 0                     |
| IM BANCO POPULAR MBS 2, FTA    | -39              | -659              | 2.089                         | 0                 | 0                     |
| IM BANKOA MBS 1, FTA           | -34              | -330              | 1.514                         | 0                 | 0                     |
| IM BCG RMBS 1, FTA             | -32              | -403              | 60                            | 0                 | 0                     |
| IM BES EMPRESAS 1, FTA         | -43              | -4.826            | 0                             | 0                 | 0                     |
| IM CAJA LABORAL 1, FTA         | -42              | -702              | 2.765                         | 0                 | 0                     |
| IM CAJA LABORAL 2, FTA         | -36              | -165              | 507                           | 0                 | 0                     |

| FONDO                                  | COMISIÓN GESTORA | IMPORTE DEVENGADO | COMISIÓN VARIABLE             |                   |                       |
|--|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------------|
|  |                  |                   | IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR |                   |                       |
|  |                  |                   | RTDO REALIZADO                | RTDO NO REALIZADO | PDAS REPERCUTIDAS (1) |
| IM CAJA LABORAL EMPRESAS 1, FTA        | -42              | -6.870            | 6.377                         | 0                 | 0                     |
| IM CAJAMAR 1, FTA                      | -15              | -478              | 2.627                         | 0                 | 0                     |
| IM CAJAMAR 3, FTA                      | -57              | -1.347            | 25.213                        | 0                 | 0                     |
| IM CAJAMAR 4, FTA                      | -56              | -1.179            | 13.010                        | 0                 | 0                     |
| IM CAJAMAR 5, FTA                      | -41              | -1.184            | 15.616                        | 0                 | 0                     |
| IM CAJAMAR 6, FTA                      | -66              | -1.190            | 12.504                        | 0                 | 0                     |
| IM CAJAMAR EMPRESAS 2 FTPYME, FTA      | -29              | -114              | 0                             | 0                 | 0                     |
| IM CAJAMAR EMPRESAS 4, FTA             | -48              | -11.994           | 22.854                        | 0                 | 0                     |
| IM CAJASTUR MBS 1, FTA                 | -48              | -734              | 682                           | 0                 | 0                     |
| IM CEDULAS 1 GRUPO BANCO POPULAR, FTA  | -85              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| IM CEDULAS 10, FTA                     | -65              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| IM CEDULAS 14, FTA                     | -60              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| IM CEDULAS 15, FTA                     | -47              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| IM CEDULAS 2, FTA                      | -74              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| IM CEDULAS 3, FTA                      | -53              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| IM CEDULAS 4, FTA                      | -104             | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| IM CEDULAS 5, FTA                      | -63              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| IM CEDULAS 7, FTA                      | -62              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| IM CEDULAS 9, FTA                      | -64              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| IM CFS RMBS 1, FTA                     | -3               | -1                | 0                             | 0                 | 0                     |
| IM CITI TARJETAS 1, FTA                | -11              | -36.306           | 36.306                        | 0                 | 0                     |
| IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA            | -15              | -2.439            | 0                             | 0                 | -110                  |
| IM FTGENCAT SABADELL 3, FTA            | -15              | -85               | 0                             | 0                 | -80                   |
| IM FTGENCAT SABADELL 4, FTA            | -17              | -265              | 0                             | 0                 | -93                   |
| IM FTPYME SABADELL 3, FTA              | -15              | -1.280            | 5.503                         | 0                 | 0                     |
| IM FTPYME SABADELL 7, FTA              | -19              | -24               | 0                             | 0                 | -181                  |
| IM FTPYME SABADELL 9, FTA              | -50              | -17.745           | 21.383                        | 0                 | 0                     |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, FTA | -17              | -2.106            | 30.941                        | 0                 | 0                     |

| FONDO                                  | COMISIÓN GESTORA | IMPORTE DEVENGADO | COMISIÓN VARIABLE             |                   |        |                       |
|--|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|--------|-----------------------|
|  |                  |                   | IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR |                   |        | PDAS REPERCUTIDAS (1) |
|  |                  |                   | RTDO REALIZADO                | RTDO NO REALIZADO |        |                       |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 3, FTA | -45              | -8.692            | 31.500                        | 0                 | 0      |                       |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 4, FTA | -59              | -250              | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I FTA    | -24              | -2.644            | 43.284                        | 0                 | 0      |                       |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME II, FTA  | -17              | -166              | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| IM GRUPO BANCO POPULAR LEASING 2, FTA  | -50              | 0                 | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| IM PASTOR 2, FTH                       | -27              | -387              | 3.230                         | 0                 | 0      |                       |
| IM PASTOR 3, FTH                       | -32              | 1                 | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| IM PASTOR 4, FTA                       | -41              | -292              | 9.952                         | 0                 | 0      |                       |
| IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, FTA       | -20              | -169              | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| IM SABADELL EMPRESAS 1, FTA            | -17              | -347              | 0                             | 0                 | -174   |                       |
| IM SABADELL EMPRESAS 3, FTA            | -41              | -2.087            | 0                             | 0                 | -463   |                       |
| IM SABADELL EMPRESAS 5, FTA            | -31              | -1.046            | 0                             | 0                 | -166   |                       |
| IM SABADELL RMBS 2, FTA                | -44              | -1.599            | 8.556                         | 0                 | 0      |                       |
| IM SABADELL RMBS 3, FTA                | -48              | -841              | 7.719                         | 0                 | 0      |                       |
| IM TERRASSA 1 FTGENCAT FTA             | -15              | -25               | 3.956                         | 0                 | 0      |                       |
| IM TERRASSA MBS 1, FTA                 | -47              | 0                 | 0                             | 0                 | -34    |                       |
| INTERMONEY MASTER CEDULAS, FTA         | -83              | 0                 | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS III, FTA   | -45              | -1.711            | 0                             | 0                 | -3     |                       |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS IV, FTA    | -37              | -2.319            | 0                             | 0                 | -3     |                       |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS V, FTA     | -58              | -8.275            | 14.119                        | 0                 | 0      |                       |
| MADRID CONSUMO I, FTA                  | -47              | 0                 | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| MADRID FTPYME I, FTA                   | -51              | 0                 | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| MADRID FTPYME II, FTA                  | -50              | 0                 | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| MADRID ICO-FTVPO I, FTA                | -41              | 0                 | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| MADRID RESIDENCIAL I, FTA              | -61              | 0                 | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| MADRID RESIDENCIAL II, FTA             | -41              | 0                 | 807                           | 0                 | 0      |                       |
| MADRID RMBS I, FTA                     | -96              | 0                 | 1.600                         | 0                 | -1.600 |                       |
| MADRID RMBS II, FTA                    | -88              | 0                 | 0                             | 0                 | 0      |                       |

| FONDO                           | COMISIÓN GESTORA | IMPORTE DEVENGADO | COMISIÓN VARIABLE             |                   |   |                       |
|---------------------------------|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|---|-----------------------|
|                                 |                  |                   | IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR |                   |   | PDAS REPERCUTIDAS (1) |
|                                 |                  |                   | RTDO REALIZADO                | RTDO NO REALIZADO |   |                       |
| MADRID RMBS III FTA             | -102             | 0                 | 0                             | 0                 | 0 | 0                     |
| MADRID RMBS IV, FTA             | -81              | 0                 | 0                             | 0                 | 0 | 0                     |
| MBS BANCAJA 1 FTA               | -22              | -169              | 1.117                         | 0                 | 0 | 0                     |
| MBS BANCAJA 2, FTA              | -26              | -508              | 4.962                         | 0                 | 0 | 0                     |
| MBS BANCAJA 3, FTA              | -32              | -747              | 5.709                         | 0                 | 0 | 0                     |
| MBS BANCAJA 4, FTA              | -67              | -2.690            | 19.549                        | 0                 | 0 | 0                     |
| MBS BANCAJA 6, FTA              | -55              | -4.723            | 7.212                         | 0                 | 0 | 0                     |
| MBS BANCAJA 7, FTA              | -55              | -4.497            | 5.825                         | 0                 | 0 | 0                     |
| MBS BANCAJA 8, FTA              | -32              | -2.555            | 2.227                         | 0                 | 0 | 0                     |
| MBSCAT 1, FTA                   | -74              | 0                 | 1.260                         | 0                 | 0 | -1.260                |
| MBSCAT 2, FTA                   | -54              | 0                 | 0                             | 0                 | 0 | 0                     |
| PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA       | 0                | 0                 | 1.142                         | 0                 | 0 | 0                     |
| PYME BANCAJA 5, FTA             | -23              | 0                 | 1.083                         | 0                 | 0 | -1.254                |
| PYME BANCAJA 7, FTA             | -31              | 0                 | 0                             | 0                 | 0 | -263                  |
| PYME VALENCIA 1, FTA            | -15              | 0                 | 2.929                         | 0                 | 0 | -2.930                |
| PYME VALENCIA 2, FTA            | -16              | 0                 | 0                             | 0                 | 0 | -56                   |
| PYMECAT 2 FTPYME, FTA           | -21              | 0                 | 898                           | 0                 | 0 | -898                  |
| PYMECAT 3 FTPYME, FTA           | -18              | 0                 | 0                             | 0                 | 0 | 0                     |
| PYMES BANESTO 2, FTA            | -25              | 0                 | 6.751                         | 0                 | 0 | -6.946                |
| RURAL CEDULA I, FTA             | -12              | -27               | 40                            | 0                 | 0 | 0                     |
| RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA | -46              | -498              | 5.614                         | 0                 | 0 | 0                     |
| RURAL HIPOTECARIO II FTH        | -13              | -278              | 134                           | 0                 | 0 | 0                     |
| RURAL HIPOTECARIO III FTH       | -15              | -660              | 209                           | 0                 | 0 | 0                     |
| RURAL HIPOTECARIO IV FTH        | -17              | -1.237            | 615                           | 0                 | 0 | 0                     |
| RURAL HIPOTECARIO IX, FTA       | -74              | -991              | 16.507                        | 0                 | 0 | -25                   |
| RURAL HIPOTECARIO V FTA         | -26              | -1.698            | 1.747                         | 0                 | 0 | 0                     |
| RURAL HIPOTECARIO VI, FTA       | -41              | -746              | 2.439                         | 0                 | 0 | 0                     |
| RURAL HIPOTECARIO VII, FTA      | -46              | -954              | 2.902                         | 0                 | 0 | 0                     |



| FONDO                                     | COMISIÓN GESTORA | IMPORTE DEVENGADO | COMISIÓN VARIABLE             |                   |        |                       |
|---|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|--------|-----------------------|
|   |                  |                   | IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR |                   |        | PDAS REPERCUTIDAS (1) |
|   |                  |                   | RTDO REALIZADO                | RTDO NO REALIZADO |        |                       |
| RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA               | -65              | -1.478            | 8.968                         | 0                 | 0      |                       |
| RURAL HIPOTECARIO X, FTA                  | -75              | -1.524            | 8.066                         | 0                 | 0      |                       |
| RURAL HIPOTECARIO XI, FTA                 | -88              | -521              | 4.783                         | 0                 | 0      |                       |
| RURAL HIPOTECARIO XII, FTA                | -60              | -963              | 2.477                         | 0                 | 0      |                       |
| RURALPYME 1 FTPYME FTA                    | -11              | 0                 | 452                           | 0                 | -466   |                       |
| RURALPYME 2 FTPYME FTA                    | -14              | -129              | 1.518                         | 0                 | 0      |                       |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN 09-1, FTA        | -26              | 0                 | 997                           | 0                 | -997   |                       |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2010-1, FTA | -37              | -1.633            | 3.114                         | 0                 | -3.114 |                       |
| SANTANDER HIPOTECARIO I, FTA              | -77              | -1.286            | 5.601                         | 0                 | -738   |                       |
| SOL-LION, FTA                             | -53              | -6.226            | 11.012                        | 0                 | 0      |                       |
| TDA 11, FTH                               | -15              | -644              | 1.063                         | 0                 | 0      |                       |
| TDA 12, FTH                               | -18              | -728              | 824                           | 0                 | 0      |                       |
| TDA 13 - MIXTO, FTA                       | -18              | -674              | 727                           | 0                 | 0      |                       |
| TDA 14 - MIXTO, FTA                       | -28              | -1.526            | 1.457                         | 0                 | 0      |                       |
| TDA 15 - MIXTO, FTA                       | -36              | -1.178            | 3.248                         | 0                 | 0      |                       |
| TDA 16 - MIXTO, FTA                       | -33              | -1.151            | 3.824                         | 0                 | 0      |                       |
| TDA 17 - MIXTO, FTA                       | -46              | -1.201            | 1.934                         | 0                 | 0      |                       |
| TDA 18 - MIXTO, FTA                       | -52              | -1.029            | 2.199                         | 0                 | 0      |                       |
| TDA 19 - MIXTO, FTA                       | -60              | -919              | 3.292                         | 0                 | 0      |                       |
| TDA 20 - MIXTO, FTA                       | -63              | -608              | 966                           | 0                 | 0      |                       |
| TDA 22 - MIXTO, FTA                       | -73              | -245              | 10.446                        | 0                 | 0      |                       |
| TDA 23, FTA                               | -80              | -442              | 9.581                         | 0                 | 0      |                       |
| TDA 24, FTA                               | -58              | 0                 | 7.652                         | 0                 | -1.552 |                       |
| TDA 25, FTA                               | -30              | 0                 | 463                           | 0                 | -463   |                       |
| TDA 26 - MIXTO, FTA                       | -29              | -809              | 5.998                         | 0                 | 0      |                       |
| TDA 27, FTA                               | -53              | -254              | 7.941                         | 0                 | -4.679 |                       |
| TDA 28, FTA                               | -34              | 0                 | 0                             | 0                 | 0      |                       |
| TDA 29, FTA                               | -33              | -1.117            | 8.611                         | 0                 | 0      |                       |

| FONDO                       | COMISIÓN GESTORA | IMPORTE DEVENGADO | COMISIÓN VARIABLE             |                   |                       |
|-----------------------------|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------------|
|                             |                  |                   | IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR |                   |                       |
|                             |                  |                   | RTDO REALIZADO                | RTDO NO REALIZADO | PDAS REPERCUTIDAS (1) |
| TDA 30, FTA                 | -19              | -479              | 3.760                         | 0                 | 0                     |
| TDA 31, FTA                 | -16              | -207              | 1.833                         | 0                 | 0                     |
| TDA CAJAMAR 2, FTA          | -50              | -1.192            | 16.272                        | 0                 | 0                     |
| TDA CAM 1, FTA              | -26              | -748              | 3.032                         | 0                 | 0                     |
| TDA CAM 10, FTA             | -56              | -2.449            | 15.304                        | 0                 | 0                     |
| TDA CAM 11, FTA             | -113             | -2.061            | 5.974                         | 0                 | 0                     |
| TDA CAM 12, FTA             | -133             | -437              | 12.967                        | 0                 | 0                     |
| TDA CAM 2, FTA              | -29              | -649              | 5.520                         | 0                 | 0                     |
| TDA CAM 3, FTA              | -32              | -923              | 5.685                         | 0                 | 0                     |
| TDA CAM 4, FTA              | -68              | -1.952            | 14.638                        | 0                 | 0                     |
| TDA CAM 5, FTA              | -70              | -2.597            | 33.532                        | 0                 | 0                     |
| TDA CAM 6, FTA              | -60              | -1.597            | 26.359                        | 0                 | 0                     |
| TDA CAM 7, FTA              | -74              | -2.626            | 33.718                        | 0                 | 0                     |
| TDA CAM 8, FTA              | -70              | -2.275            | 24.275                        | 0                 | 0                     |
| TDA CAM 9, FTA              | -64              | -1.775            | 21.674                        | 0                 | 0                     |
| TDA CORPORATIVOS I, FTA     | -39              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| TDA EMPRESAS 1, FTA         | -16              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| TDA EMPRESAS 2, FTA         | -15              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| TDA FTPYME PASTOR 9, FTA    | -21              | 0                 | 94                            | 0                 | 0                     |
| TDA IBERCAJA 1, FTA         | -27              | -346              | 857                           | 0                 | 0                     |
| TDA IBERCAJA 2, FTA         | -39              | -906              | 1.548                         | 0                 | 0                     |
| TDA IBERCAJA 3, FTA         | -49              | -855              | 1.975                         | 0                 | 0                     |
| TDA IBERCAJA 4, FTA         | -57              | -822              | 4.243                         | 0                 | 0                     |
| TDA IBERCAJA 5, FTA         | -56              | -702              | 3.243                         | 0                 | 0                     |
| TDA IBERCAJA 6, FTA         | -80              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| TDA IBERCAJA 7, FTA         | -130             | -619              | 3.537                         | 0                 | 0                     |
| TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH | -22              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| TDA LICO LEASING III, FTA   | -7               | -592              | 592                           | 0                 | 0                     |

| FONDO                                   | COMISIÓN GESTORA | IMPORTE DEVENGADO | COMISIÓN VARIABLE             |                   |                       |
|---|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------------|
|   |                  |                   | IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR |                   |                       |
|   |                  |                   | RTDO REALIZADO                | RTDO NO REALIZADO | PDAS REPERCUTIDAS (1) |
| TDA PASTOR 1, FTA                       | -14              | -489              | 5.412                         | 0                 | 0                     |
| TDA PASTOR CONSUMO 1, FTA               | -21              | 0                 | 0                             | 0                 | -39                   |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA           | -19              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA           | -19              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| TDA TARRAGONA 1, FTA                    | -20              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| UNICAJA ANDALUCIA FTVIVIENDA TDA 1, FTA | -17              | -196              | 1.059                         | 0                 | 0                     |
| UNICAJA AYT EMPRESAS I, FTA             | -16              | 0                 | 220                           | 0                 | -20                   |
| UNICAJA TDA VPO, FTA                    | -17              | -308              | 1.210                         | 0                 | 0                     |
| VAL BANCAJA 1, FTA                      | -21              | -1.444            | 3.145                         | 0                 | 0                     |
| VALENCIA HIPOTECARIO 1, FTA             | -15              | -234              | 398                           | 0                 | 0                     |
| VALENCIA HIPOTECARIO 2, FTH             | -40              | -525              | 10.033                        | 0                 | 0                     |
| VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA             | -45              | -560              | 9.800                         | 0                 | 0                     |
| VALENCIA HIPOTECARIO 4, FTA             | -53              | 0                 | 3.801                         | 0                 | -4.123                |
| VALENCIA HIPOTECARIO 5, FTA             | -32              | 0                 | 100                           | 0                 | -212                  |
| <b>Subtotal BONOS 2012 2</b>            | <b>-19.006</b>   | <b>-347.704</b>   | <b>1.843.618</b>              | <b>-1.540</b>     | <b>-527.429</b>       |
| <b>Subtotal BONOS 2011 2</b>            | <b>-23.015</b>   | <b>-332.817</b>   | <b>1.776.861</b>              | <b>408</b>        | <b>-602.451</b>       |
| <b>%Variación</b>                       | <b>-17,42</b>    | <b>4,47</b>       | <b>3,76</b>                   | <b>-477,45</b>    | <b>-12,45</b>         |
| <b>PAGARÉS</b>                          |                  |                   |                               |                   |                       |
| FTA SANTANDER 2                         | -216             | -22.419           | 33.958                        | 0                 | -6.025                |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2012 2</b>          | <b>-216</b>      | <b>-22.419</b>    | <b>33.958</b>                 | <b>0</b>          | <b>-6.025</b>         |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2011 2</b>          | <b>-275</b>      | <b>-2.277</b>     | <b>27.928</b>                 | <b>0</b>          | <b>-8.409</b>         |
| <b>%Variación</b>                       | <b>-21,45</b>    | <b>884,58</b>     | <b>21,59</b>                  | <b>-</b>          | <b>-28,35</b>         |
| <b>Total 2012 2</b>                     | <b>-19.222</b>   | <b>-370.123</b>   | <b>1.877.576</b>              | <b>-1.540</b>     | <b>-533.454</b>       |
| <b>Total 2011 2</b>                     | <b>-23.290</b>   | <b>-335.094</b>   | <b>1.804.789</b>              | <b>408</b>        | <b>-610.860</b>       |
| <b>%Variación</b>                       | <b>-17,47</b>    | <b>10,45</b>      | <b>4,03</b>                   | <b>-477,45</b>    | <b>-12,67</b>         |

Nota: Importes en miles de euros

(1) Importe de las correcciones de valor por repercusión de pérdidas

| FONDO                                 | GASTOS DE EXPLOTACIÓN |                |                |               |                  |                | DETERIORO | RTDO ACTIVOS NC EN VTA (5) |
|---------------------------------------|-----------------------|----------------|----------------|---------------|------------------|----------------|-----------|----------------------------|
|                                       | MI (1)                | INT EC (2)     | IMPORTE        | % / TA (3)    | % COMISIONES (4) |                |           |                            |
| <b>BONOS</b>                          |                       |                |                |               |                  |                |           |                            |
| AYT ADMINISTRACIONES I, FTA           | 0                     | 0              | 0              | 0,00          | 0,00             | 0              | 0         |                            |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES II, FTA  | 1                     | -105           | 0              | 0,00          | 0,00             | 0              | 0         |                            |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES III, FTA | 7                     | -20            | 1              | 0,00          | 0,00             | 0              | 0         |                            |
| AYT LICO LEASING I, FTA               | 17                    | -72            | -165           | -0,26         | -0,24            | -489           | 0         |                            |
| AYT PRESTIGE CAJAS DE AHORRO, FTA     | 0                     | -57            | -24            | -0,01         | 0,00             | 0              | 0         |                            |
| AYT.10, FINANCIACION INVERSIONES, FTA | 3                     | -78            | -4             | 0,00          | 0,00             | 0              | 0         |                            |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA Nº 2,FTA  | 713                   | 0              | -62            | -0,45         | -0,35            | -547           | 0         |                            |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA Nº 3, FTA | 472                   | 0              | -73            | -0,43         | -0,35            | -1.061         | 0         |                            |
| CAJA SAN FERNANDO CDO I, FTA          | 200                   | -976           | -45            | -0,09         | -0,03            | -4.708         | 0         |                            |
| CAP-TDA 2, FTA                        | 2.296                 | 0              | -2.297         | -0,58         | -0,58            | -37            | 0         |                            |
| EMPRESAS TDA CAM 10, FTA              | 4.762                 | -408           | -76            | -0,01         | -0,01            | -34.088        | 0         |                            |
| GC COMPASS SPAIN 2, FTA               | -813                  | 0              | -53            | -0,09         | -0,09            | 0              | 0         |                            |
| MORTGAGE FINANCE SPAIN, FTA           | -7                    | 0              | -46            | -0,02         | -0,02            | 0              | 0         |                            |
| SOFINLOC ESPAÑA TDA Nº 1, FTA         | 842                   | 0              | -127           | -0,44         | -0,40            | -1.577         | 0         |                            |
| TDA FS1, FTA                          | 45                    | 0              | -48            | -0,04         | -0,04            | 0              | 0         |                            |
| VALENCIA ACTIVOS 1, FTA               | 12.035                | -373           | -131           | -0,01         | -0,01            | -23.825        | 0         |                            |
| <b>Subtotal BONOS 2012 2</b>          | <b>20.573</b>         | <b>-2.089</b>  | <b>-3.150</b>  | <b>-0,08</b>  | <b>-0,08</b>     | <b>-66.332</b> | <b>0</b>  |                            |
| <b>Subtotal BONOS 2011 2</b>          | <b>3.107</b>          | <b>-1.485</b>  | <b>-3.358</b>  | <b>-0,10</b>  | <b>-0,10</b>     | <b>-10.885</b> | <b>0</b>  |                            |
| <b>%Variación</b>                     | <b>562</b>            | <b>40,67</b>   | <b>-6,19</b>   | <b>-20,00</b> | <b>-20,00</b>    | <b>509,39</b>  | <b>-</b>  |                            |
| <b>PAGARÉS</b>                        |                       |                |                |               |                  |                |           |                            |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2012 2</b>        | <b>0</b>              | <b>0</b>       | <b>0</b>       | <b>0,00</b>   | <b>0,00</b>      | <b>0</b>       | <b>0</b>  |                            |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2011 2</b>        | <b>25.282</b>         | <b>-25.312</b> | <b>-7</b>      | <b>0,00</b>   | <b>0,00</b>      | <b>0</b>       | <b>0</b>  |                            |
| <b>%Variación</b>                     | <b>-100</b>           | <b>-100,00</b> | <b>-100,00</b> | <b>-</b>      | <b>-</b>         | <b>-</b>       | <b>-</b>  |                            |
| <b>Total 2012 2</b>                   | <b>20.573</b>         | <b>-2.089</b>  | <b>-3.150</b>  | <b>-0,08</b>  | <b>-0,08</b>     | <b>-66.332</b> | <b>0</b>  |                            |
| <b>Total 2011 2</b>                   | <b>28.389</b>         | <b>-26.797</b> | <b>-3.365</b>  | <b>-0,09</b>  | <b>-0,09</b>     | <b>-10.885</b> | <b>0</b>  |                            |
| <b>%Variación</b>                     | <b>-28</b>            | <b>-92,20</b>  | <b>-6,39</b>   | <b>-11,11</b> | <b>-11,11</b>    | <b>509,39</b>  | <b>-</b>  |                            |

Nota: Importes en miles de euros

(1) Importe de los intereses provenientes de derechos de crédito menos los devengados por los valores emitidos por el fondo, más el resultado de las operaciones de cobertura de flujos de efectivo (swap)

(2) Intereses de deudas con entidades de crédito

(3) Porcentaje que representan los gastos de explotación sobre el total activo

(4) Porcentaje que representa el importe del gasto por comisiones sobre el total activo

(5) Importe de las ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta

Margen de intereses y resultados de operaciones financieras - Fondos de titulización privados

CUADRO B.2.1

| FONDO                                 | %Variación MI (1) | INT DCHOS CREDITO (2) | INT OBLIGACIONES (3) | RESULTADO DEL SWAP | TIPO INT DCHOS CREDITO (4) | TIPO INTERÉS OBLIGACIONES (5) | EXCESO SPREAD (%) |
|---------------------------------------|-------------------|-----------------------|----------------------|--------------------|----------------------------|-------------------------------|-------------------|
| <b>BONOS</b>                          |                   |                       |                      |                    |                            |                               |                   |
| AYT ADMINISTRACIONES I, FTA           | 0,00              | 3.101                 | -3.101               | 0                  | 4,73                       | 4,73                          | 0,00              |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES II, FTA  | 0,00              | 795                   | -794                 | 0                  | 0,87                       | 0,95                          | -0,08             |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES III, FTA | -46,15            | 4.718                 | -1.955               | -2.756             | 3,68                       | 1,76                          | 1,92              |
| AYT LICO LEASING I, FTA               | -98,64            | 1.305                 | -359                 | -929               | 6,33                       | 1,62                          | 4,71              |
| AYT PRESTIGE CAJAS DE AHORRO, FTA     | 0,00              | 408                   | -408                 | 0                  | 0,87                       | 0,95                          | 0,00              |
| AYT.10, FINANCIACION INVERSIONES, FTA | -88,00            | 2.140                 | -801                 | -1.336             | 2,44                       | 1,57                          | 0,61              |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA N° 2, FTA | -78,23            | 713                   | 0                    | 0                  | 9,97                       | 0,00                          | 0,00              |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA N° 3, FTA | -87,23            | 847                   | -375                 | 0                  | 8,87                       | 4,90                          | 3,98              |
| CAJA SAN FERNANDO CDO I, FTA          | -77,14            | 674                   | -607                 | 133                | 1,58                       | 1,38                          | 0,20              |
| CAP-TDA 2, FTA                        | -1.029,55         | 5.042                 | -2.746               | 0                  | 0,00                       | 1,68                          | 0,00              |
| EMPRESAS TDA CAM 10, FTA              | 230,24            | 8.787                 | -4.025               | 0                  | 3,64                       | 1,59                          | 2,05              |
| GC COMPASS SPAIN 2, FTA               | -67,65            | 0                     | -813                 | 0                  | 0,00                       | 0,00                          | 0,00              |
| MORTGAGE FINANCE SPAIN, FTA           | -104,24           | 1.036                 | -1.043               | 0                  | 1,22                       | 1,28                          | -0,06             |
| SOFINLOC ESPAÑA TDA N° 1, FTA         | -57,52            | 1.230                 | -388                 | 0                  | 8,12                       | 2,65                          | 5,47              |
| TDA FS1, FTA                          | -100,78           | 2.911                 | -606                 | -2.260             | 4,81                       | 1,28                          | 3,53              |
| VALENCIA ACTIVOS 1, FTA               | 0,00              | 18.525                | -6.490               | 0                  | 3,83                       | 1,53                          | 2,30              |
| <b>Subtotal BONOS 2012 2</b>          | <b>371,97</b>     | <b>52.232</b>         | <b>-24.511</b>       | <b>-7.148</b>      | <b>2,79</b>                | <b>1,59</b>                   | <b>1,31</b>       |
| <b>Subtotal BONOS 2011 2</b>          | <b>0,00</b>       | <b>42.653</b>         | <b>-27.569</b>       | <b>-11.977</b>     | <b>2,95</b>                | <b>1,87</b>                   | <b>0,97</b>       |
| <b>%Variación</b>                     | <b>-</b>          | <b>22,46</b>          | <b>-11,09</b>        | <b>-40,32</b>      | <b>-5,42</b>               | <b>-14,97</b>                 | <b>35,05</b>      |
| <b>PAGARÉS</b>                        |                   |                       |                      |                    |                            |                               |                   |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2012 2</b>        | <b>-100,00</b>    | <b>0</b>              | <b>0</b>             | <b>0</b>           | <b>0,00</b>                | <b>0,00</b>                   | <b>0,00</b>       |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2011 2</b>        | <b>0,00</b>       | <b>25.282</b>         | <b>0</b>             | <b>0</b>           | <b>5</b>                   | <b>0</b>                      | <b>0,00</b>       |
| <b>%Variación</b>                     | <b>-</b>          | <b>-100,00</b>        | <b>-</b>             | <b>-</b>           | <b>-100,00</b>             | <b>-</b>                      | <b>-</b>          |
| <b>Total 2012 2</b>                   | <b>-62,96</b>     | <b>52.232</b>         | <b>-24.511</b>       | <b>-7.148</b>      | <b>2,79</b>                | <b>1,59</b>                   | <b>1,31</b>       |
| <b>Total 2011 2</b>                   | <b>0,00</b>       | <b>67.935</b>         | <b>-27.569</b>       | <b>-11.977</b>     | <b>3,12</b>                | <b>1,67</b>                   | <b>0,88</b>       |
| <b>%Variación</b>                     | <b>-</b>          | <b>-23,11</b>         | <b>-11,09</b>        | <b>-40,32</b>      | <b>-10,58</b>              | <b>-4,79</b>                  | <b>48,86</b>      |

Nota: Importes en miles de euros

(1) Porcentaje de variación interanual del importe de los intereses devengados por los derechos de créditos menos los devengados por los valores emitidos, más los rendimientos generados por las operaciones de cobertura de flujos de efectivo.

(2) Importe de intereses de derechos de crédito

(3) Importe de intereses de obligaciones y otros valores negociables.

(4) Tipo de interés interanual medio ponderado de los activos

(5) Tipo de interés interanual medio ponderado de los pasivos emitidos

| FONDO                                 | COMISIÓN GESTORA | IMPORTE DEVENGADO | COMISIÓN VARIABLE             |                   |                       |
|---------------------------------------|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------------|
|                                       |                  |                   | IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR |                   |                       |
|                                       |                  |                   | RTDO REALIZADO                | RTDO NO REALIZADO | PDAS REPERCUTIDAS (1) |
| <b>BONOS</b>                          |                  |                   |                               |                   |                       |
| AYT ADMINISTRACIONES I, FTA           | 0                | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES II, FTA  | 0                | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES III, FTA | 0                | 5                 | 106                           | 0                 | 0                     |
| AYT LICO LEASING I, FTA               | -18              | -134              | 0                             | 0                 | 0                     |
| AYT PRESTIGE CAJAS DE AHORRO, FTA     | 0                | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| AYT.10, FINANCIACION INVERSIONES, FTA | 0                | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA Nº 2, FTA | -3               | 0                 | 0                             | 0                 | -21                   |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA Nº 3, FTA | -3               | 0                 | 0                             | 0                 | -16                   |
| CAJA SAN FERNANDO CDO I, FTA          | 0                | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| CAP-TDA 2, FTA                        | -35              | -2.248            | 0                             | 0                 | 0                     |
| EMPRESAS TDA CAM 10, FTA              | -53              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| GC COMPASS SPAIN 2, FTA               | -45              | 0                 | 0                             | 0                 | 0                     |
| MORTGAGE FINANCE SPAIN, FTA           | -10              | 0                 | 247                           | 0                 | -163                  |
| SOFINLOC ESPAÑA TDA Nº 1, FTA         | -32              | 0                 | 0                             | 0                 | -19                   |
| TDA FS1, FTA                          | -40              | -4                | 291                           | 0                 | 0                     |
| VALENCIA ACTIVOS 1, FTA               | -53              | 0                 | 0                             | 0                 | -17                   |
| <b>Subtotal BONOS 2012 2</b>          | <b>-292</b>      | <b>-2.381</b>     | <b>644</b>                    | <b>0</b>          | <b>-236</b>           |
| <b>Subtotal BONOS 2011 2</b>          | <b>-404</b>      | <b>-2.226</b>     | <b>1.731</b>                  | <b>0</b>          | <b>-67</b>            |
| <b>%Variación</b>                     | <b>-27,72</b>    | <b>6,96</b>       | <b>-62,80</b>                 | <b>-</b>          | <b>252,24</b>         |
| <b>PAGARÉS</b>                        |                  |                   |                               |                   |                       |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2012 2</b>        |                  |                   |                               |                   |                       |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2011 2</b>        | <b>0</b>         | <b>0</b>          | <b>0</b>                      | <b>0</b>          | <b>0</b>              |
| <b>%Variación</b>                     | <b>-</b>         | <b>-</b>          | <b>-</b>                      | <b>-</b>          | <b>-</b>              |
| <b>Total 2012 2</b>                   | <b>-292</b>      | <b>-2.381</b>     | <b>644</b>                    | <b>0</b>          | <b>-236</b>           |
| <b>Total 2011 2</b>                   | <b>-404</b>      | <b>-2.226</b>     | <b>1.731</b>                  | <b>0</b>          | <b>-67</b>            |
| <b>%Variación</b>                     | <b>-27,72</b>    | <b>6,96</b>       | <b>-62,80</b>                 | <b>-</b>          | <b>252,24</b>         |

Nota: Importes en miles de euros

(1) Importe de las correcciones de valor por repercusión de pérdidas

## Principales flujos de efectivo en el semestre - Fondos de titulización públicos

CUADRO C.1

| FONDO                                   | ADQUISICIÓN / EMISIÓN |                  | INTERESES            |                  |               | AMORTIZACIONES       |                  | PAGOS COMISIONES (3) |            |
|---|-----------------------|------------------|----------------------|------------------|---------------|----------------------|------------------|----------------------|------------|
|   | DCHOS CREDITO<br>(5)  | OBLIGACIONES (1) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | DERIVADOS (2) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | IMPORTE              | % / TA (4) |
| <b>BONOS</b>                            |                       |                  |                      |                  |               |                      |                  |                      |            |
| AUTO ABS 2012-3, FTA                    | -800.000              | 800.000          | 5.737                | 0                | 0             | 26.115               | 0                | -100                 | -0,01      |
| AYT ANDALUCIA FTEMPRESA CAJAMAR, FTA    | 0                     | 0                | 2.862                | -966             | -1.538        | 14.995               | -18.147          | -21                  | -0,01      |
| AYT CAIXA GALICIA EMPRESAS I, FTA       | 0                     | 0                | 4.000                | -3.354           | -1.940        | 28.396               | -27.196          | -32                  | -0,01      |
| AYT CAIXA SABADELL HIPOTECARIO I, FTA   | 0                     | 0                | 4.106                | -1.886           | -2.157        | 6.063                | -8.739           | -36                  | -0,01      |
| AYT CAIXANOVA FTPYME I, FTA             | 0                     | 0                | 1.041                | -789             | -581          | 8.685                | -13.720          | -14                  | -0,02      |
| AYT CAIXANOVA HIPOTECARIO I, FTA        | 0                     | 0                | 2.994                | -1.323           | -1.856        | 9.256                | -7.239           | -39                  | -0,02      |
| AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA              | -450.000              | 450.000          | 14.038               | -5.791           | 0             | 31.569               | -28.461          | -8.017               | -0,85      |
| AYT CAJA MURCIA HIPOTECARIO I, FTA      | 0                     | 0                | 1.753                | -520             | -754          | 7.173                | -8.327           | -604                 | -0,48      |
| AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA      | 0                     | 0                | 3.446                | -723             | -2.126        | 9.863                | -9.189           | -314                 | -0,15      |
| AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FTA      | 0                     | 0                | 1.907                | -625             | -782          | 8.397                | -8.500           | -651                 | -0,44      |
| AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA            | 0                     | 0                | 1.253.893            | -1.185.340       | 0             | 4.963.000            | -4.963.000       | -3.988               | -0,01      |
| AYT CEDULAS CAJAS IV, FTA               | 0                     | 0                | 0                    | 0                | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| AYT CEDULAS CAJAS IX, FTA               | 0                     | 0                | 60.052               | -131.250         | 0             | 0                    | 0                | -90                  | 0,00       |
| AYT CEDULAS CAJAS V, FTA                | 0                     | 0                | 144.968              | -144.402         | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| AYT CEDULAS CAJAS VI, FTA               | 0                     | 0                | 0                    | 0                | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| AYT CEDULAS CAJAS VIII, FTA             | 0                     | 0                | 167.017              | -166.750         | 0             | 0                    | 0                | -1                   | 0,00       |
| AYT CEDULAS CAJAS X, FTA                | 0                     | 0                | 4.995                | -83.811          | 0             | 0                    | 0                | -106                 | 0,00       |
| AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FTA    | 0                     | 0                | 16.602               | -11.369          | -6.284        | 192.292              | -209.452         | -163                 | -0,03      |
| AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA | 0                     | 0                | 135.868              | -36.646          | -38.813       | 541.197              | -517.827         | -6.112               | -0,13      |
| AYT DEUDA SUBORDINADA I, FTA            | 0                     | 0                | 2.030                | -1.155           | 0             | 0                    | 0                | -154                 | -0,05      |
| AYT FONDO EOLICO, FTA                   | 0                     | 0                | 493                  | -650             | 0             | 0                    | 0                | -60                  | -0,29      |
| AYT FTPYME II, FTA                      | 0                     | 0                | 808                  | -480             | -494          | 8.595                | -8.689           | -22                  | -0,02      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO II, FTH          | 0                     | 0                | 2.386                | -1.003           | -1.309        | 16.636               | -14.927          | -28                  | -0,01      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO III, FTH         | 0                     | 0                | 2.953                | -1.259           | -1.704        | 16.334               | -14.381          | -31                  | -0,01      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, FTH          | 0                     | 0                | 2.877                | -1.140           | -1.801        | 18.844               | -17.379          | -118                 | -0,04      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH          | 0                     | 0                | 6.311                | -2.527           | -3.817        | 24.191               | -23.083          | -67                  | -0,01      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH          | 0                     | 0                | 3.065                | -1.366           | -1.933        | 18.256               | -16.620          | -428                 | -0,13      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH         | 0                     | 0                | 7.077                | -2.287           | -4.411        | 34.874               | -29.819          | -600                 | -0,08      |

## Principales flujos de efectivo en el semestre - Fondos de titulización públicos

CUADRO C.1

| FONDO                                  | ADQUISICIÓN / EMISIÓN |                  | INTERESES            |                  |               | AMORTIZACIONES       |                  | PAGOS COMISIONES (3) |            |
|--|-----------------------|------------------|----------------------|------------------|---------------|----------------------|------------------|----------------------|------------|
|  | DCHOS CREDITO<br>(5)  | OBLIGACIONES (1) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | DERIVADOS (2) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | IMPORTE              | % / TA (4) |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH       | 0                     | 0                | 11.239               | -3.900           | -6.812        | 55.415               | -52.737          | -575                 | -0,05      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH          | 0                     | 0                | 6.819                | -2.375           | -3.808        | 25.951               | -23.983          | -77                  | -0,01      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH         | 0                     | 0                | 8.517                | -3.207           | -5.101        | 29.805               | -28.203          | -92                  | -0,01      |
| AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH        | 0                     | 0                | 5.412                | -2.301           | -3.611        | 21.819               | -19.753          | -96                  | -0,02      |
| AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA          | 0                     | 0                | 33.750               | -23.104          | -11.605       | 115.509              | -106.780         | -1.217               | -0,03      |
| AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA           | 0                     | 0                | 11.812               | -9.793           | -4.083        | 39.394               | -47.307          | -201                 | -0,02      |
| AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA            | 0                     | 0                | 14.743               | -10.990          | -5.438        | 45.204               | -44.085          | -224                 | -0,02      |
| AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA             | 0                     | 0                | 6.651                | -3.149           | -2.508        | 17.948               | -16.066          | -694                 | -0,14      |
| AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA            | 0                     | 0                | 8.272                | -3.784           | -2.921        | 23.647               | -20.428          | -1.403               | -0,23      |
| AYT HIPOTECARIO III, FTH               | 0                     | 0                | 1.231                | -338             | 0             | 6.180                | -5.755           | -965                 | -1,15      |
| AYT HIPOTECARIO IV, FTH                | 0                     | 0                | 1.390                | -303             | -188          | 5.894                | -6.063           | -861                 | -1,16      |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FTA          | 0                     | 0                | 2.544                | -929             | -1.422        | 11.548               | -9.430           | -639                 | -0,39      |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA         | 0                     | 0                | 2.176                | -431             | -1.169        | 4.496                | -4.010           | -20                  | -0,02      |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, FTA          | 0                     | 0                | 1.976                | -656             | -1.000        | 9.418                | -8.931           | -221                 | -0,14      |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA           | 0                     | 0                | 7.062                | -2.690           | -4.238        | 17.173               | -22.320          | -213                 | -0,06      |
| AYT HIPOTECARIO MIXTO, FTA             | 0                     | 0                | 1.541                | -386             | -57           | 3.727                | -4.121           | -356                 | -0,35      |
| AYT ICO FTVPO CAJA GALICIA I, FTA      | 0                     | 0                | 2.096                | -645             | -1.182        | 6.049                | -5.289           | -32                  | -0,02      |
| AYT ICO-FTVPO CAJA MURCIA, FTA         | 0                     | 0                | 1.785                | -577             | -795          | 4.500                | -4.257           | -29                  | -0,02      |
| AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA    | 0                     | 0                | 1.265                | -719             | -536          | 5.165                | -4.056           | -30                  | -0,02      |
| AYT ICO-FTVPO I, FTA                   | 0                     | 0                | 3.557                | -1.246           | -2.062        | 13.540               | -11.242          | -59                  | -0,02      |
| AYT ICO-FTVPO III, FTA                 | 0                     | 0                | 4.379                | -1.874           | -1.281        | 8.864                | -12.033          | -229                 | -0,17      |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA           | 0                     | 0                | 4.745                | -1.740           | -2.790        | 18.122               | -14.005          | -662                 | -0,14      |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA          | 0                     | 0                | 12.059               | -3.168           | -8.556        | 39.517               | -27.940          | -90                  | -0,01      |
| AYT KUTXA HIPOTECARIO IV, FTA          | 0                     | 0                | 22.995               | -15.711          | -7.871        | 124.793              | -41.037          | -122                 | -0,01      |
| AYT PRESTAMOS CONSUMO III, FTA         | 0                     | 0                | 1.098                | -278             | -638          | 8.283                | -9.976           | -20                  | -0,07      |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS II, FTA  | 0                     | 0                | 797                  | -191             | -421          | 2.787                | -3.445           | -19                  | -0,02      |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS III, FTA | 0                     | 0                | 967                  | -306             | -580          | 5.370                | -3.916           | -19                  | -0,02      |
| AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS IV, FTA  | 0                     | 0                | 989                  | -250             | -844          | 8.974                | -10.269          | -21                  | -0,02      |
| AYT SA NOSTRA FINANCIACION I, FTA      | 0                     | 0                | 868                  | -172             | -228          | 7.356                | -6.967           | -89                  | -0,41      |



## Principales flujos de efectivo en el semestre - Fondos de titulización públicos

CUADRO C.1

| FONDO                                   | ADQUISICIÓN / EMISIÓN |                  | INTERESES            |                  |               | AMORTIZACIONES       |                  | PAGOS COMISIONES (3) |            |
|---|-----------------------|------------------|----------------------|------------------|---------------|----------------------|------------------|----------------------|------------|
|   | DCHOS CREDITO<br>(5)  | OBLIGACIONES (1) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | DERIVADOS (2) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | IMPORTE              | % / TA (4) |
| AYT UNICAJA FINANCIACION I, FTA         | 0                     | 0                | 6.131                | -1.397           | -3.535        | 45.455               | -50.374          | -25                  | -0,01      |
| AYT VPO II, FTA                         | 0                     | 0                | 1.881                | -627             | -863          | 6.983                | -6.600           | -22                  | -0,02      |
| AYT.1, FTH                              | 0                     | 0                | 1.106                | -213             | 0             | 4.064                | -4.050           | -330                 | -0,92      |
| AYT.11, FTH                             | 0                     | 0                | 1.357                | -617             | -72           | 5.624                | -5.207           | -591                 | -0,65      |
| AYT.2, FTH                              | 0                     | 0                | 256                  | -100             | 0             | 2.105                | -2.127           | -157                 | -0,86      |
| AYT.7, PROMOCIONES INMOBILIARIAS I, FTA | 0                     | 0                | 348                  | -169             | 0             | 2.104                | -1.928           | -58                  | -0,17      |
| BANCAJA - BVA VPO 1, FTA                | 0                     | 0                | 4.629                | -1.518           | -951          | 13.083               | -12.771          | -195                 | -0,06      |
| BANCAJA 10, FTA                         | 0                     | 0                | 19.900               | -5.656           | -10.388       | 52.854               | -52.442          | -103                 | -0,01      |
| BANCAJA 11, FTA                         | 0                     | 0                | 16.956               | -5.677           | -8.598        | 43.710               | -44.489          | -80                  | -0,01      |
| BANCAJA 13, FTA                         | 0                     | 0                | 29.198               | -12.091          | -14.062       | 77.242               | -72.729          | -104                 | 0,00       |
| BANCAJA 3, FTA                          | 0                     | 0                | 2.288                | -931             | -925          | 17.669               | -17.330          | -845                 | -0,51      |
| BANCAJA 4, FTH                          | 0                     | 0                | 2.419                | -701             | -1.342        | 12.602               | -11.942          | -715                 | -0,39      |
| BANCAJA 5, FTA                          | 0                     | 0                | 2.743                | -1.032           | -1.405        | 12.571               | -13.736          | -63                  | -0,03      |
| BANCAJA 6, FTA                          | 0                     | 0                | 6.157                | -2.120           | -3.093        | 27.492               | -27.097          | -725                 | -0,15      |
| BANCAJA 7, FTA                          | 0                     | 0                | 7.237                | -2.249           | -3.848        | 28.545               | -28.018          | -1.441               | -0,25      |
| BANCAJA 8, FTA                          | 0                     | 0                | 7.749                | -3.001           | -3.652        | 25.859               | -22.437          | -3.353               | -0,51      |
| BANCAJA 9, FTA                          | 0                     | 0                | 11.717               | -3.082           | -5.757        | 38.230               | -37.477          | -79                  | -0,01      |
| BANCAJA LEASING 1, FTA                  | 0                     | 0                | 6.447                | -2.223           | 0             | 28.956               | -34.388          | -39                  | -0,01      |
| BANKINTER 10, FTA                       | 0                     | 0                | 8.152                | -3.076           | -4.616        | 35.238               | -35.068          | -322                 | -0,04      |
| BANKINTER 11, FTH                       | 0                     | 0                | 4.836                | -1.992           | -2.959        | 21.059               | -19.803          | -50                  | -0,01      |
| BANKINTER 12, FTH                       | 0                     | 0                | 6.598                | -2.159           | -3.685        | 26.406               | -25.294          | -495                 | -0,08      |
| BANKINTER 13 FTA                        | 0                     | 0                | 10.173               | -3.981           | -5.967        | 34.579               | -36.830          | -78                  | -0,01      |
| BANKINTER 2 PYME FTA                    | 0                     | 0                | 2.531                | -912             | -1.436        | 21.079               | -22.128          | -25                  | -0,01      |
| BANKINTER 2, FTH                        | 0                     | 0                | 395                  | -367             | 0             | 3.919                | -3.941           | -202                 | -0,53      |
| BANKINTER 3 FTPYME FTA                  | 0                     | 0                | 2.814                | -1.055           | -1.622        | 19.847               | -25.905          | -25                  | -0,01      |
| BANKINTER 3, FTH                        | 0                     | 0                | 2.717                | -1.257           | -1.533        | 19.627               | -19.866          | -329                 | -0,13      |
| BANKINTER 4 FTPYME, FTA                 | 0                     | 0                | 2.253                | -1.051           | -1.285        | 16.044               | -25.459          | -20                  | -0,01      |
| BANKINTER 4, FTH                        | 0                     | 0                | 2.801                | -1.074           | -1.595        | 17.830               | -16.408          | -414                 | -0,16      |
| BANKINTER 5, FTH                        | 0                     | 0                | 2.042                | -743             | -1.129        | 11.294               | -9.910           | -297                 | -0,17      |

## Principales flujos de efectivo en el semestre - Fondos de titulización públicos

CUADRO C.1

| FONDO                     | ADQUISICIÓN / EMISIÓN |                  | INTERESES            |                  |               | AMORTIZACIONES       |                  | PAGOS COMISIONES (3) |            |
|---------------------------|-----------------------|------------------|----------------------|------------------|---------------|----------------------|------------------|----------------------|------------|
|                           | DCHOS CREDITO<br>(5)  | OBLIGACIONES (1) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | DERIVADOS (2) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | IMPORTE              | % / TA (4) |
| BANKINTER 6, FTA          | 0                     | 0                | 4.871                | -1.780           | -2.739        | 25.587               | -23.667          | -497                 | -0,11      |
| BANKINTER 7, FTH          | 0                     | 0                | 1.808                | -567             | -976          | 8.872                | -8.189           | -177                 | -0,11      |
| BANKINTER 8, FTA          | 0                     | 0                | 4.024                | -1.239           | -2.172        | 19.495               | -18.524          | -78                  | -0,02      |
| BANKINTER 9, FTA          | 0                     | 0                | 8.813                | -1.817           | -3.630        | 37.075               | -38.773          | -426                 | -0,09      |
| BBVA AUTOS 1 FTA          | 0                     | 0                | 645                  | -70              | -387          | 10.117               | -10.423          | -35                  | -0,12      |
| BBVA AUTOS 2 FTA          | 0                     | 0                | 4.586                | -470             | -2.691        | 30.869               | -34.325          | -1.519               | -1,15      |
| BBVA CONSUMO 1, FTA       | 0                     | 0                | 6.776                | -698             | -3.991        | 41.683               | -47.427          | -45                  | -0,03      |
| BBVA CONSUMO 2, FTA       | 0                     | 0                | 9.353                | -785             | -5.404        | 60.796               | -64.641          | -52                  | -0,02      |
| BBVA CONSUMO 3 FTA        | 0                     | 0                | 9.509                | -1.167           | -6.134        | 60.811               | -60.815          | -58                  | -0,03      |
| BBVA CONSUMO 4 FTA        | 0                     | 0                | 21.392               | -2.549           | -15.793       | 115.909              | -131.487         | -94                  | -0,01      |
| BBVA CONSUMO 5, FTA       | 0                     | 0                | 28.343               | -3.108           | -22.291       | 108.766              | -123.013         | -118                 | -0,01      |
| BBVA EMPRESAS 1, FTA      | 0                     | 0                | 2.592                | -1.360           | -1.044        | 33.938               | -35.763          | -46                  | -0,02      |
| BBVA EMPRESAS 2, FTA      | 0                     | 0                | 10.047               | -5.278           | -3.610        | 165.282              | -160.170         | -149                 | -0,01      |
| BBVA EMPRESAS 3, FTA      | 0                     | 0                | 10.552               | -3.901           | -5.325        | 152.339              | -188.227         | -127                 | -0,01      |
| BBVA EMPRESAS 4, FTA      | 0                     | 0                | 9.581                | -3.313           | -6.130        | 196.252              | -220.422         | -118                 | -0,01      |
| BBVA EMPRESAS 5, FTA      | 0                     | 0                | 10.012               | -3.389           | -5.141        | 139.413              | -146.654         | -118                 | -0,01      |
| BBVA EMPRESAS 6, FTA      | 0                     | 0                | 14.865               | -5.070           | -9.527        | 182.161              | -166.666         | -801                 | -0,08      |
| BBVA FINANZIA AUTOS 1 FTA | 0                     | 0                | 4.429                | -614             | -3.124        | 30.347               | -36.059          | -31                  | -0,03      |
| BBVA HIPOTECARIO 3, FTA   | 0                     | 0                | 2.565                | -795             | -1.324        | 33.790               | -37.636          | -46                  | -0,02      |
| BBVA LEASING 1, FTA       | 0                     | 0                | 4.413                | -1.551           | -2.111        | 70.291               | -74.383          | -87                  | -0,02      |
| BBVA RMBS 1, FTA          | 0                     | 0                | 19.425               | -5.298           | -9.666        | 39.677               | -43.211          | -185                 | -0,01      |
| BBVA RMBS 10, FTA         | 0                     | 0                | 18.980               | -7.284           | -9.949        | 25.702               | -24.914          | -2.509               | -0,14      |
| BBVA RMBS 11, FTA         | 1                     | 0                | 19.918               | -5.650           | 0             | 25.066               | -14.955          | -6.815               | -0,42      |
| BBVA RMBS 2, FTA          | 0                     | 0                | 38.172               | -10.301          | -19.258       | 86.241               | -93.865          | -307                 | -0,01      |
| BBVA RMBS 3, FTA          | 0                     | 0                | 28.975               | -8.662           | -15.429       | 33.795               | -46.550          | -229                 | -0,01      |
| BBVA RMBS 5 FTA           | 0                     | 0                | 51.425               | -14.539          | -30.945       | 105.413              | -141.999         | -344                 | -0,01      |
| BBVA RMBS 9, FTA          | 0                     | 0                | 16.737               | -4.525           | -10.130       | 25.196               | -28.177          | -153                 | -0,01      |
| BBVA-3 FTPYME FTA         | 0                     | 0                | 1.190                | -221             | -843          | 10.466               | -12.046          | -36                  | -0,06      |
| BBVA-4 PYME, FTA          | 0                     | 0                | 800                  | -296             | -389          | 13.781               | -13.642          | -37                  | -0,05      |

## Principales flujos de efectivo en el semestre - Fondos de titulización públicos

CUADRO C.1

| FONDO                                 | ADQUISICIÓN / EMISIÓN |                  | INTERESES            |                  |               | AMORTIZACIONES       |                  | PAGOS COMISIONES (3) |            |
|---------------------------------------|-----------------------|------------------|----------------------|------------------|---------------|----------------------|------------------|----------------------|------------|
|                                       | DCHOS CREDITO<br>(5)  | OBLIGACIONES (1) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | DERIVADOS (2) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | IMPORTE              | % / TA (4) |
| BBVA-5 FTPYME, FTA                    | 0                     | 0                | 2.227                | -587             | -1.156        | 38.245               | -41.282          | -177                 | -0,09      |
| BBVA-6 FTPYME FTA                     | 0                     | 0                | 2.471                | -667             | -1.256        | 37.416               | -39.958          | -48                  | -0,02      |
| BBVA-7 FTGENCAT, FTA                  | 0                     | 0                | 595                  | -261             | -273          | 7.071                | -8.728           | -33                  | -0,06      |
| BBVA-8 FTPYME FTA                     | 0                     | 0                | 3.100                | -1.394           | -1.381        | 43.626               | -54.114          | -52                  | -0,02      |
| BBVA-9 PYME FTA                       | -470.035              | 470.000          | 388                  | 0                | 0             | 6.429                | 0                | 0                    | 0,00       |
| BCL MUNICIPIOS I FTA                  | 0                     | 0                | 618                  | -506             | -116          | 12.579               | -11.330          | -29                  | -0,02      |
| CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA              | 0                     | 0                | 8.000                | -1.949           | -3.965        | 21.582               | -27.044          | -1.390               | -0,27      |
| CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA              | 0                     | 0                | 6.600                | -2.036           | -3.237        | 21.664               | -22.326          | -1.135               | -0,26      |
| CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA    | 0                     | 0                | 3.515                | -1.528           | -1.790        | 20.082               | -21.482          | -299                 | -0,11      |
| CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA        | 0                     | 0                | 3.396                | -814             | -1.639        | 22.350               | -26.679          | -1.129               | -0,50      |
| CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA            | 0                     | 0                | 2.500                | -921             | 0             | 7.969                | -6.363           | -1.663               | -0,68      |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, FTA    | 0                     | 0                | 0                    | 0                | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 5, FTA    | 0                     | 0                | 0                    | 0                | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| CEDULAS TDA 15, FTA                   | 0                     | 0                | 5.625                | -5.625           | 0             | 688.000              | -687.999         | 0                    | 0,00       |
| CEDULAS TDA 17, FTA                   | 0                     | 0                | 61.684               | -61.684          | 0             | 800.000              | -800.000         | -2                   | 0,00       |
| CEDULAS TDA 18, FTA                   | 0                     | 0                | 7.838                | -7.838           | 0             | 670.000              | -670.000         | -5                   | 0,00       |
| CEDULAS TDA 2, FTA                    | 0                     | 0                | 90.180               | -89.957          | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| CEDULAS TDA 21, FONDO DE TITULIZACION | 0                     | 0                | 129.625              | -105.975         | 0             | 600.000              | -600.000         | -1                   | 0,00       |
| CEDULAS TDA 3, FTA                    | 0                     | 0                | 0                    | 0                | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| CEDULAS TDA 5, FTA                    | 0                     | 0                | 61.875               | -61.845          | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| CEDULAS TDA 6, FTA                    | 0                     | 0                | 0                    | 0                | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| CEDULAS TDA 7, FTA                    | 0                     | 0                | 0                    | -36              | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| CIBELES III FTPYME, FTA               | 0                     | 0                | 532                  | -467             | -127          | 7.692                | -8.292           | -11                  | -0,01      |
| CM BANCAJA 1, FTA                     | 0                     | 0                | 873                  | -465             | -449          | 11.996               | -10.316          | -29                  | -0,03      |
| CONSUMO BANCAJA 1, FTA                | 0                     | 0                | 1.010                | -117             | -379          | 12.327               | -14.017          | -11                  | -0,05      |
| DRIVER ESPAÑA ONE, FTA                | 0                     | 0                | 9.203                | -2.605           | -2.737        | 112.919              | -101.356         | -1.883               | -0,61      |
| EDT FTPYME PASTOR 3, FTA              | 0                     | 0                | 553                  | -333             | -120          | 5.059                | -5.918           | -70                  | -0,14      |
| EMPRESAS BANESTO 2, FTA               | 0                     | 0                | 5.074                | -3.161           | -4.098        | 82.103               | -106.063         | -58                  | -0,01      |
| EMPRESAS BANESTO 5, FTA               | 0                     | 0                | 10.549               | -5.824           | -2.756        | 105.101              | -139.342         | -77                  | -0,01      |

## Principales flujos de efectivo en el semestre - Fondos de titulización públicos

CUADRO C.1

| FONDO  | ADQUISICIÓN / EMISIÓN |                  | INTERESES            |                  |               | AMORTIZACIONES       |                  | PAGOS COMISIONES (3) |            |
|--|-----------------------|------------------|----------------------|------------------|---------------|----------------------|------------------|----------------------|------------|
|  | DCHOS CREDITO<br>(5)  | OBLIGACIONES (1) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | DERIVADOS (2) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | IMPORTE              | % / TA (4) |
| EMPRESAS BANESTO 6, FTA                                    | 0                     | 0                | 10.979               | -10.097          | -3.547        | 123.079              | -123.510         | 1.554                | 0,17       |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 3, FTA                        | 0                     | 0                | 2.616                | -985             | -2.075        | 19.753               | -24.708          | -36                  | -0,02      |
| EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 5, FTA                        | 0                     | 0                | 7.938                | -2.270           | -4.570        | 42.197               | -44.523          | -67                  | -0,01      |
| FTA PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZ. DE CED. HIPOTECARIA | 0                     | 0                | 61.624               | -61.500          | 0             | 0                    | 0                | -60                  | 0,00       |
| FINANCAT 1, FTA  | 0                     | 0                | 4.452                | -1.221           | -1.938        | 34.442               | -42.040          | -36                  | -0,03      |
| FINANCIACION BANESTO 1, FTA                                | 0                     | 0                | 1.778                | -253             | -1.202        | 17.965               | -20.021          | -30                  | -0,07      |
| FONCAIXA AUTONOMOS 1, FTA                                  | 0                     | 0                | 15.711               | -8.832           | -4.256        | 69.407               | -74.656          | -105                 | -0,01      |
| FONCAIXA CONSUMO 1, FTA                                    | 0                     | 0                | 56.609               | -29.099          | -15.468       | 263.676              | -278.326         | -3.042               | -0,11      |
| FONCAIXA EMPRESAS 3, FTA                                   | 0                     | 0                | 15.218               | -12.404          | -909          | 125.931              | -421.786         | -117                 | -0,01      |
| FONCAIXA FTGENCAT 3, FTA                                   | 0                     | 0                | 2.536                | -553             | -1.453        | 13.200               | -15.596          | -31                  | -0,02      |
| FONCAIXA FTGENCAT 4, FTA                                   | 0                     | 0                | 3.159                | -949             | -1.914        | 13.334               | -16.761          | -41                  | -0,02      |
| FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA                                   | 0                     | 0                | 7.884                | -2.269           | -4.677        | 31.441               | -39.605          | -45                  | -0,01      |
| FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA                                   | 0                     | 0                | 5.796                | -1.766           | -3.076        | 23.011               | -28.884          | -39                  | -0,01      |
| FONCAIXA LEASINGS 1, FTA                                   | 0                     | 0                | 14.757               | -10.548          | -781          | 146.960              | -537.850         | -151                 | -0,01      |
| FONCAIXA PYMES 3, FTA                                      | -2.400.000            | 2.400.000        | 1.891                | 0                | 0             | 133.815              | 0                | 0                    | 0,00       |
| FTA FTPYME SANTANDER 1                                     | 0                     | 0                | 4.185                | -1.742           | -1.409        | 34.265               | -36.218          | -648                 | -0,23      |
| FTA FTPYME SANTANDER 2                                     | 0                     | 0                | 4.991                | -2.036           | -1.660        | 34.790               | -35.935          | -2.081               | -0,56      |
| FTA PYMES SANTANDER 3                                      | -1.570.000            | 1.884.000        | 23.996               | -10.407          | 0             | 316.753              | -142.068         | -99                  | -0,01      |
| FTA PYMES SANTANDER 4                                      | -2.650.000            | 3.180.000        | 6.821                | 0                | 0             | 288.934              | 0                | 0                    | 0,00       |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 07-1                     | 0                     | 0                | 6.255                | -852             | -4.137        | 83.149               | -86.393          | -26                  | -0,01      |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2011-1                   | 0                     | 0                | 24.810               | -14.923          | -11.120       | 105.702              | -105.021         | -76                  | -0,01      |
| FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2012-1                   | -500.001              | 425.000          | 2.530                | 0                | 0             | 15.115               | 0                | 0                    | 0,00       |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 10, FTA                             | 0                     | 0                | 43.603               | -26.974          | -25.537       | 733.475              | -1.325.085       | -373                 | -0,01      |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 2                                   | 0                     | 0                | 3.997                | -1.706           | -1.294        | 42.507               | -50.584          | -41                  | -0,01      |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 4                                   | 0                     | 0                | 10.354               | -4.221           | -2.352        | 87.985               | -103.197         | -276                 | -0,03      |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 8, FTA                              | 0                     | 0                | 43.297               | -27.307          | -5.618        | 726.564              | -994.527         | -452                 | -0,01      |
| FTA SANTANDER EMPRESAS 9, FTA                              | 0                     | 0                | 38.824               | -18.564          | -9.531        | 551.090              | -702.901         | 574                  | 0,02       |

## Principales flujos de efectivo en el semestre - Fondos de titulización públicos

CUADRO C.1

| FONDO  | ADQUISICIÓN / EMISIÓN |                  | INTERESES            |                  |               | AMORTIZACIONES       |                  | PAGOS COMISIONES (3) |            |
|--|-----------------------|------------------|----------------------|------------------|---------------|----------------------|------------------|----------------------|------------|
|  | DCHOS CREDITO<br>(5)  | OBLIGACIONES (1) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | DERIVADOS (2) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | IMPORTE              | % / TA (4) |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 1                                 | 0                     | 0                | 3.401                | -849             | 134           | 31.625               | -33.645          | -35                  | -0,02      |
| FTA SANTANDER FINANCIACION 5                                 | 0                     | 0                | 28.546               | -1.925           | -13.010       | 159.891              | -176.047         | -2.450               | -0,31      |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2                                  | 0                     | 0                | 11.744               | -4.072           | -5.222        | 43.609               | -56.285          | -123                 | -0,01      |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3                                  | 0                     | 0                | 20.880               | -7.259           | -8.350        | 70.733               | -93.072          | -179                 | -0,01      |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 6                                  | 0                     | 0                | 9.138                | -4.732           | -1.566        | 36.557               | -64.950          | -105                 | -0,01      |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 7                                  | 0                     | 0                | 18.599               | -16.037          | -2.232        | 61.306               | -61.143          | -205                 | -0,01      |
| FTA SANTANDER HIPOTECARIO 8                                  | 0                     | 0                | 10.048               | -3.960           | -2.509        | 30.213               | -39.077          | -3.763               | -0,43      |
| FTA SANTANDER PUBLICO 1                                      | 0                     | 0                | 2.560                | -1.159           | -1.031        | 42.689               | -43.239          | -42                  | -0,01      |
| FTA UCI 11   | 0                     | 0                | 4.502                | -867             | 0             | 6.237                | -6.273           | -3.243               | -1,21      |
| FTA UCI 14   | 0                     | 0                | 12.456               | -2.021           | 0             | 11.162               | -16.186          | -2.717               | -0,40      |
| FTA UCI 16   | 0                     | 0                | 18.893               | -3.458           | 0             | 18.535               | -34.359          | -75                  | -0,01      |
| FTA UCI 18   | 0                     | 0                | 18.755               | -4.883           | -4.257        | 19.326               | -26.527          | -1.321               | -0,11      |
| FTA UCI 6  | 0                     | 0                | 750                  | -230             | 0             | 2.963                | -3.031           | -514                 | -0,93      |
| FTA UCI 7  | 0                     | 0                | 926                  | -238             | 0             | 3.431                | -3.270           | -640                 | -0,98      |
| FTA UCI 8  | 0                     | 0                | 1.288                | -308             | 0             | 3.000                | -3.098           | -825                 | -0,92      |
| FTA UCI 9  | 0                     | 0                | 3.504                | -914             | 0             | 8.235                | -7.939           | -2.574               | -1,05      |
| FTA, HIPOTEBANSA 11  | 0                     | 0                | 3.209                | -957             | -964          | 15.701               | -15.194          | -1.123               | -0,46      |
| FTA, HIPOTEBANSA X   | 0                     | 0                | 2.135                | -508             | -827          | 11.843               | -11.436          | -798                 | -0,55      |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 1                                    | 0                     | 0                | 4.293                | -1.801           | -1.649        | 33.589               | -43.588          | -47                  | -0,01      |
| FTA, SANTANDER EMPRESAS 3                                    | 0                     | 0                | 9.664                | -3.825           | -3.049        | 80.296               | -78.340          | -74                  | -0,01      |
| FTA, UCI 15  | 0                     | 0                | 14.229               | -3.359           | 0             | 11.757               | -15.726          | -3.258               | -0,41      |
| FTA, UCI 17  | 0                     | 0                | 12.882               | -2.872           | -3.867        | 17.999               | -24.371          | -117                 | -0,01      |
| FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA | -2.192.822            | 2.390.837        | 296.383              | -197.352         | 0             | 249.884              | 0                | -1.837               | -0,01      |
| FTH UCI 10   | 0                     | 0                | 2.437                | -575             | 0             | 6.517                | -6.479           | -1.890               | -1,05      |
| FTH UCI 12   | 0                     | 0                | 6.153                | -1.142           | 0             | 7.127                | -7.657           | -4.567               | -1,25      |
| FTH UCI 5  | 0                     | 0                | 354                  | -97              | 0             | 1.535                | -1.546           | -237                 | -0,93      |
| FTPyme BANCAJA 2 FTA   | 0                     | 0                | 511                  | -203             | -191          | 4.719                | -4.935           | -16                  | -0,04      |
| FTPyme BANCAJA 3 FTA   | 0                     | 0                | 673                  | -282             | -230          | 7.585                | -8.320           | -19                  | -0,03      |

## Principales flujos de efectivo en el semestre - Fondos de titulización públicos

CUADRO C.1

| FONDO                              | ADQUISICIÓN / EMISIÓN |                  | INTERESES            |                  |               | AMORTIZACIONES       |                  | PAGOS COMISIONES (3) |            |
|------------------------------------|-----------------------|------------------|----------------------|------------------|---------------|----------------------|------------------|----------------------|------------|
|                                    | DCHOS CREDITO<br>(5)  | OBLIGACIONES (1) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | DERIVADOS (2) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | IMPORTE              | % / TA (4) |
| FTPYME BANCAJA 6 FTA               | 0                     | 0                | 1.968                | -602             | -1.056        | 16.249               | -23.419          | -22                  | -0,01      |
| FTPYME TDA 6, FTA                  | 0                     | 0                | 354                  | -71              | -209          | 4.357                | -3.759           | -23                  | -0,10      |
| FTPYME TDA 7, FTA                  | 0                     | 0                | 1.112                | -424             | -567          | 10.326               | -13.891          | -23                  | -0,03      |
| FTPYME TDA CAM 2, FTA              | 0                     | 0                | 1.104                | -339             | -705          | 11.042               | -15.884          | -30                  | -0,03      |
| FTPYME TDA CAM 4, FTA              | 0                     | 0                | 5.196                | -1.210           | -3.885        | 30.533               | -42.510          | -50                  | -0,01      |
| FTPYME TDA CAM 7, FTA              | 0                     | 0                | 6.558                | -2.771           | -3.111        | 42.649               | -54.205          | -58                  | -0,01      |
| FTPYME TDA CAM 9, FTA              | 0                     | 0                | 7.026                | -1.157           | 0             | 57.525               | -82.587          | -65                  | -0,01      |
| GAT FTGENCAT 2005, FTA             | 0                     | 0                | 930                  | -358             | -554          | 8.841                | -10.442          | -31                  | -0,04      |
| GAT FTGENCAT 2006, FTA             | 0                     | 0                | 1.002                | -258             | -575          | 8.764                | -10.069          | -24                  | -0,04      |
| GAT FTGENCAT 2007, FTA             | 0                     | 0                | 2.319                | -422             | -1.126        | 14.097               | -18.819          | -33                  | -0,02      |
| GAT FTGENCAT 2008, FTA             | 0                     | 0                | 3.864                | -2.264           | -1.424        | 28.134               | -38.404          | -44                  | -0,01      |
| GAT FTGENCAT 2009, FTA             | 0                     | 0                | 4.479                | -451             | 0             | 29.367               | -38.824          | -31                  | -0,01      |
| GAT ICO-FTVPO 1, FTH               | 0                     | 0                | 4.108                | -1.655           | -2.069        | 15.939               | -15.184          | -81                  | -0,03      |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 1, FTA  | 0                     | 0                | 1.641                | 13               | -1.140        | 10.869               | -11.767          | -28                  | -0,03      |
| GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 2, FTA  | 0                     | 0                | 1.982                | -915             | -542          | 6.617                | -8.595           | -36                  | -0,02      |
| GC FTGENCAT CAIXA TARRAGONA 1, FTA | 0                     | 0                | 2.171                | -815             | -771          | 18.462               | -16.560          | -25                  | -0,02      |
| GC FTGENCAT SABADELL 1, FTA        | 0                     | 0                | 1.472                | -353             | -886          | 22.274               | -21.852          | -24                  | -0,02      |
| GC FTPYME PASTOR 4, FTA            | 0                     | 0                | 1.367                | -487             | -841          | 9.636                | -21.643          | -23                  | -0,02      |
| GC FTPYME SABADELL 4, FTA          | 0                     | 0                | 1.824                | -396             | -1.201        | 17.244               | -19.438          | -25                  | -0,02      |
| GC FTPYME SABADELL 5, FTA          | 0                     | 0                | 3.399                | -1.230           | -2.094        | 33.880               | -39.061          | -31                  | -0,01      |
| GC FTPYME SABADELL 6, FTA          | 0                     | 0                | 3.806                | -1.373           | -2.304        | 29.335               | -34.481          | -31                  | -0,01      |
| GC FTPYME SABADELL 8, FTA          | 0                     | 0                | 10.233               | -6.472           | -2.553        | 80.642               | -96.646          | -47                  | -0,01      |
| GC FTPYME UNNIM 1, FTA             | 0                     | 0                | 4.581                | -2.780           | -1.141        | 29.197               | -31.129          | -52                  | -0,02      |
| GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA       | 0                     | 0                | 6.454                | -1.379           | -4.096        | 12.545               | -14.970          | -42                  | -0,01      |
| GC SABADELL 1, FTH                 | 0                     | 0                | 5.718                | -1.217           | -3.510        | 24.726               | -24.045          | -521                 | -0,14      |
| GC SABADELL EMPRESAS 2, FTA        | 0                     | 0                | 3.550                | -1.666           | -1.932        | 31.265               | -38.449          | -27                  | -0,01      |
| GC SABADELL EMPRESAS 4, FTA        | 0                     | 0                | 3.364                | -1.893           | -1.277        | 35.750               | -44.283          | -22                  | -0,01      |
| HIPOCAT 10, FTA                    | 0                     | 0                | 8.806                | -2.470           | -4.842        | 18.084               | -18.159          | -122                 | -0,02      |
| HIPOCAT 11, FTA                    | 0                     | 0                | 8.928                | -2.499           | -4.924        | 17.242               | -20.011          | -131                 | -0,02      |

## Principales flujos de efectivo en el semestre - Fondos de titulización públicos

CUADRO C.1

| FONDO                           | ADQUISICIÓN / EMISIÓN |                  | INTERESES            |                  |               | AMORTIZACIONES       |                  | PAGOS COMISIONES (3) |            |
|---------------------------------|-----------------------|------------------|----------------------|------------------|---------------|----------------------|------------------|----------------------|------------|
|                                 | DCHOS CREDITO<br>(5)  | OBLIGACIONES (1) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | DERIVADOS (2) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | IMPORTE              | % / TA (4) |
| HIPOCAT 14, FTA                 | 0                     | 0                | 6.700                | -2.698           | -3.106        | 24.946               | -25.973          | -286                 | -0,07      |
| HIPOCAT 16, FTA                 | 0                     | 0                | 8.177                | -2.631           | -3.591        | 34.221               | -30.954          | -2.227               | -0,35      |
| HIPOCAT 17, FTA                 | 0                     | 0                | 10.171               | -2.766           | -4.791        | 23.829               | -25.950          | -94                  | -0,01      |
| HIPOCAT 18, FTA                 | 0                     | 0                | 7.693                | -3.126           | 0             | 19.824               | -18.813          | -5.472               | -0,80      |
| HIPOCAT 19, FTA                 | 0                     | 0                | 7.782                | -943             | 0             | 16.265               | -18.777          | -3.024               | -0,48      |
| HIPOCAT 20, FTA                 | 0                     | 0                | 10.856               | -1.242           | 0             | 24.006               | -24.972          | -8.927               | -1,07      |
| HIPOCAT 4, FTA                  | 0                     | 0                | 1.114                | -238             | -696          | 3.699                | -3.471           | -605                 | -1,04      |
| HIPOCAT 5, FTA                  | 0                     | 0                | 2.806                | -690             | -1.685        | 7.071                | -7.595           | -528                 | -0,34      |
| HIPOCAT 6, FTA                  | 0                     | 0                | 3.976                | -882             | -2.481        | 8.515                | -8.244           | -720                 | -0,30      |
| HIPOCAT 7, FTA                  | 0                     | 0                | 6.937                | -1.990           | -3.903        | 13.603               | -15.372          | -167                 | -0,03      |
| HIPOCAT 8, FTA                  | 0                     | 0                | 8.538                | -1.879           | -5.365        | 22.291               | -26.059          | -127                 | -0,02      |
| HIPOCAT 9, FTA                  | 0                     | 0                | 5.698                | -1.788           | -3.057        | 14.775               | -15.947          | -105                 | -0,02      |
| ICO MEDIACION I AYT, FTA        | 0                     | 0                | 5.576                | -2.094           | -4.167        | 251.100              | -285.210         | -625                 | -0,09      |
| ICO MEDIACION II AYT FTA        | 0                     | 0                | 103.457              | -40.719          | -30.938       | 2.423.548            | -2.689.962       | -33.601              | -0,20      |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 1, FTA  | 0                     | 0                | 3.973                | -870             | -2.554        | 19.944               | -26.387          | -19                  | -0,01      |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 2, FTA  | 0                     | 0                | 7.462                | -2.337           | -4.840        | 26.208               | -34.201          | -353                 | -0,08      |
| IM BANCO POPULAR FTPYME 3, FTA  | 0                     | 0                | 19.572               | -4.576           | 0             | 119.786              | -151.302         | -840                 | -0,07      |
| IM BANCO POPULAR MBS 2, FTA     | 0                     | 0                | 9.438                | -2.591           | -4.695        | 12.971               | -17.972          | -214                 | -0,03      |
| IM BANKOA MBS 1, FTA            | 0                     | 0                | 4.483                | -1.650           | -2.147        | 14.067               | -14.829          | -86                  | -0,02      |
| IM BCG RMBS 1, FTA              | 0                     | 0                | 3.430                | -1.308           | -1.762        | 10.405               | -9.768           | -287                 | -0,08      |
| IM BES EMPRESAS 1, FTA          | 0                     | 0                | 6.600                | -673             | 0             | 42.761               | -55.489          | -2.530               | -0,64      |
| IM CAJA LABORAL 1, FTA          | 0                     | 0                | 5.131                | -2.062           | -2.890        | 24.905               | -22.608          | -536                 | -0,11      |
| IM CAJA LABORAL 2, FTA          | 0                     | 0                | 5.218                | -2.410           | -3.003        | 10.315               | -11.996          | -53                  | -0,01      |
| IM CAJA LABORAL EMPRESAS 1, FTA | 0                     | 0                | 3.464                | -516             | 0             | 29.453               | -33.119          | -54                  | -0,01      |
| IM CAJAMAR 1, FTA               | 0                     | 0                | 1.890                | -577             | -840          | 5.565                | -5.979           | -781                 | -0,61      |
| IM CAJAMAR 3, FTA               | 0                     | 0                | 8.807                | -1.905           | -5.178        | 20.703               | -24.984          | -66                  | -0,01      |
| IM CAJAMAR 4, FTA               | 0                     | 0                | 8.530                | -2.159           | -5.125        | 18.616               | -22.130          | -206                 | -0,04      |
| IM CAJAMAR 5, FTA               | 0                     | 0                | 10.172               | -2.181           | -6.057        | 24.006               | -31.475          | -61                  | -0,01      |
| IM CAJAMAR 6, FTA               | 0                     | 0                | 21.684               | -5.299           | -13.470       | 40.210               | -54.979          | -74                  | -0,01      |

## Principales flujos de efectivo en el semestre - Fondos de titulización públicos

CUADRO C.1

| FONDO                                  | ADQUISICIÓN / EMISIÓN |                  | INTERESES            |                  |               | AMORTIZACIONES       |                  | PAGOS COMISIONES (3) |            |
|--|-----------------------|------------------|----------------------|------------------|---------------|----------------------|------------------|----------------------|------------|
|  | DCHOS CREDITO<br>(5)  | OBLIGACIONES (1) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | DERIVADOS (2) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | IMPORTE              | % / TA (4) |
| IM CAJAMAR EMPRESAS 2 FTPYME, FTA      | 0                     | 0                | 2.514                | -1.210           | -1.011        | 14.120               | -19.266          | -40                  | -0,02      |
| IM CAJAMAR EMPRESAS 4, FTA             | 0                     | 0                | 18.180               | -2.981           | 0             | 102.169              | -131.005         | -148                 | -0,02      |
| IM CAJASTUR MBS 1, FTA                 | 0                     | 0                | 6.396                | -1.469           | -3.497        | 15.049               | -15.845          | -94                  | -0,01      |
| IM CEDULAS 1 GRUPO BANCO POPULAR, FTA  | 0                     | 0                | 0                    | 0                | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| IM CEDULAS 10, FTA                     | 0                     | 0                | 0                    | 0                | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| IM CEDULAS 14, FTA                     | 0                     | 0                | 0                    | 0                | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| IM CEDULAS 15, FTA                     | 0                     | 0                | 41.932               | -38.590          | 0             | 400.000              | -400.000         | -108                 | -0,01      |
| IM CEDULAS 2, FTA                      | 0                     | 0                | 0                    | 0                | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| IM CEDULAS 3, FTA                      | 0                     | 0                | 42.506               | -42.397          | 0             | 0                    | 0                | -106                 | -0,01      |
| IM CEDULAS 4, FTA                      | 0                     | 0                | 0                    | 0                | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| IM CEDULAS 5, FTA                      | 0                     | 0                | 0                    | -110             | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| IM CEDULAS 7, FTA                      | 0                     | 0                | 0                    | 0                | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| IM CEDULAS 9, FTA                      | 0                     | 0                | 0                    | -450             | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| IM CFS RMBS 1, FTA                     | -378.000              | 283.500          | 63                   | 0                | 0             | 270                  | 0                | -1.070               | -0,27      |
| IM CITI TARJETAS 1, FTA                | -1.000.000            | 1.000.000        | 22.936               | 0                | 0             | 145.190              | 0                | -1.351               | -0,11      |
| IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA            | 0                     | 0                | 2.773                | -691             | -1.773        | 22.377               | -26.011          | -22                  | -0,01      |
| IM FTGENCAT SABADELL 3, FTA            | 0                     | 0                | 1.441                | -507             | -758          | 9.965                | -9.692           | -37                  | -0,04      |
| IM FTGENCAT SABADELL 4, FTA            | 0                     | 0                | 2.789                | -1.415           | -1.301        | 24.487               | -33.451          | -41                  | -0,02      |
| IM FTPYME SABADELL 3, FTA              | 0                     | 0                | 1.398                | -267             | -609          | 9.607                | -11.192          | -25                  | -0,03      |
| IM FTPYME SABADELL 7, FTA              | 0                     | 0                | 5.591                | -2.197           | -2.700        | 42.212               | -51.346          | -42                  | -0,01      |
| IM FTPYME SABADELL 9, FTA              | 0                     | 0                | 21.864               | -8.190           | 0             | 158.606              | -184.803         | -70                  | -0,01      |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, FTA | 0                     | 0                | 6.298                | -3.593           | -2.118        | 19.719               | -29.375          | -282                 | -0,08      |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 3, FTA | 0                     | 0                | 13.543               | 0                | 0             | 66.946               | 0                | -26                  | 0,00       |
| IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 4, FTA | 0                     | 0                | 24.670               | -9.799           | 0             | 268.941              | -332.959         | -1.133               | -0,07      |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I FTA    | 0                     | 0                | 7.816                | -3.493           | -2.921        | 37.544               | -45.216          | -361                 | -0,08      |
| IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME II, FTA  | 0                     | 0                | 5.041                | -1.178           | -3.157        | 25.213               | -36.966          | -276                 | -0,08      |
| IM GRUPO BANCO POPULAR LEASING 2, FTA  | 0                     | 0                | 16.072               | -11.852          | 0             | 189.479              | -716.713         | -844                 | -0,08      |
| IM PASTOR 2, FTH                       | 0                     | 0                | 3.785                | -1.057           | -2.211        | 17.046               | -17.431          | -549                 | -0,20      |
| IM PASTOR 3, FTH                       | 0                     | 0                | 5.044                | -1.134           | -3.376        | 11.344               | -14.041          | 682                  | 0,19       |



## Principales flujos de efectivo en el semestre - Fondos de titulización públicos

CUADRO C.1

| FONDO                                | ADQUISICIÓN / EMISIÓN |                  | INTERESES            |                  |               | AMORTIZACIONES       |                  | PAGOS COMISIONES (3) |            |
|--------------------------------------|-----------------------|------------------|----------------------|------------------|---------------|----------------------|------------------|----------------------|------------|
|                                      | DCHOS CREDITO<br>(5)  | OBLIGACIONES (1) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | DERIVADOS (2) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | IMPORTE              | % / TA (4) |
| IM PASTOR 4, FTA                     | 0                     | 0                | 6.216                | -1.387           | -2.910        | 13.725               | -16.695          | -439                 | -0,10      |
| IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, FTA     | 0                     | 0                | 1.900                | -1.257           | -67           | 0                    | -57.192          | 0                    | 0,00       |
| IM SABADELL EMPRESAS 1, FTA          | 0                     | 0                | 3.184                | -1.576           | -1.297        | 31.868               | -41.452          | -29                  | -0,01      |
| IM SABADELL EMPRESAS 3, FTA          | 0                     | 0                | 9.878                | -4.976           | -5.208        | 119.929              | -136.617         | -56                  | -0,01      |
| IM SABADELL EMPRESAS 5, FTA          | 0                     | 0                | 3.937                | -2.605           | -1.440        | 30.808               | -39.336          | -54                  | -0,02      |
| IM SABADELL RMBS 2, FTA              | 0                     | 0                | 13.037               | -4.897           | -6.836        | 42.076               | -45.406          | -1.084               | -0,12      |
| IM SABADELL RMBS 3, FTA              | 0                     | 0                | 15.614               | -4.335           | -10.127       | 43.045               | -47.705          | -53                  | -0,01      |
| IM TERRASSA 1 FTGENCAT FTA           | 0                     | 0                | 739                  | -274             | -426          | 5.531                | -7.951           | -16                  | -0,03      |
| IM TERRASSA MBS 1, FTA               | 0                     | 0                | 3.073                | -944             | -1.900        | 8.633                | -13.866          | -48                  | -0,02      |
| INTERMONEY MASTER CEDULAS, FTA       | 0                     | 0                | 58.091               | -57.929          | 0             | 0                    | 0                | -166                 | -0,01      |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS III, FTA | 0                     | 0                | 5.681                | -1.532           | -1.771        | 98.691               | -87.157          | -1.801               | -0,22      |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS IV, FTA  | 0                     | 0                | 7.919                | -3.247           | 192           | 19.129               | -59.763          | -2.400               | -0,28      |
| MADRID ACTIVOS CORPORATIVOS V, FTA   | 0                     | 0                | 17.585               | -5.692           | -3.759        | 108.155              | -150.178         | -3.828               | -0,32      |
| MADRID CONSUMO I, FTA                | 0                     | 0                | 6.006                | -655             | -1.622        | 58.566               | -54.954          | -1.558               | -0,75      |
| MADRID FTPYME I, FTA                 | 0                     | 0                | 7.869                | -5.723           | 4.301         | 111.053              | -117.864         | -635                 | -0,07      |
| MADRID FTPYME II, FTA                | 0                     | 0                | 14.386               | -5.531           | -1.969        | 159.365              | -154.847         | -4.050               | -0,54      |
| MADRID ICO-FTVPO I, FTA              | 0                     | 0                | 2.077                | -811             | -899          | 10.149               | -10.390          | -56                  | -0,03      |
| MADRID RESIDENCIAL I, FTA            | 0                     | 0                | 6.078                | -1.884           | -2.647        | 19.156               | -26.243          | -109                 | -0,02      |
| MADRID RESIDENCIAL II, FTA           | 0                     | 0                | 5.428                | -1.845           | -2.156        | 16.595               | -21.922          | -83                  | -0,01      |
| MADRID RMBS I, FTA                   | 0                     | 0                | 11.405               | -3.755           | -6.309        | 37.953               | -54.418          | -121                 | -0,01      |
| MADRID RMBS II, FTA                  | 0                     | 0                | 10.030               | -3.370           | -4.960        | 33.440               | -53.158          | -110                 | -0,01      |
| MADRID RMBS III FTA                  | 0                     | 0                | 18.991               | -5.378           | -8.137        | 53.469               | -70.673          | -148                 | -0,01      |
| MADRID RMBS IV, FTA                  | 0                     | 0                | 13.803               | -6.283           | -6.487        | 56.376               | -75.941          | -194                 | -0,01      |
| MBS BANCAJA 1 FTA                    | 0                     | 0                | 1.572                | -471             | -935          | 10.926               | -11.991          | -23                  | -0,02      |
| MBS BANCAJA 2, FTA                   | 0                     | 0                | 3.280                | -1.069           | -1.622        | 14.437               | -14.027          | -29                  | -0,01      |
| MBS BANCAJA 3, FTA                   | 0                     | 0                | 4.387                | -1.304           | -2.159        | 17.159               | -18.252          | -1.132               | -0,32      |
| MBS BANCAJA 4, FTA                   | 0                     | 0                | 12.505               | -4.039           | -6.291        | 48.188               | -49.860          | -71                  | -0,01      |
| MBS BANCAJA 6, FTA                   | 0                     | 0                | 9.678                | -3.675           | 0             | 38.087               | -39.363          | -2.898               | -0,35      |
| MBS BANCAJA 7, FTA                   | 0                     | 0                | 10.361               | -4.129           | 0             | 29.685               | -32.952          | -220                 | -0,03      |

## Principales flujos de efectivo en el semestre - Fondos de titulización públicos

CUADRO C.1

| FONDO                                     | ADQUISICIÓN / EMISIÓN |                  | INTERESES            |                  |               | AMORTIZACIONES       |                  | PAGOS COMISIONES (3) |            |
|---|-----------------------|------------------|----------------------|------------------|---------------|----------------------|------------------|----------------------|------------|
|   | DCHOS CREDITO<br>(5)  | OBLIGACIONES (1) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | DERIVADOS (2) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | IMPORTE              | % / TA (4) |
| MBS BANCAJA 8, FTA                        | 0                     | 0                | 5.423                | -1.934           | 0             | 11.566               | -15.186          | -649                 | -0,15      |
| MBSCAT 1, FTA                             | 0                     | 0                | 9.993                | -2.995           | -5.410        | 21.458               | -25.018          | -88                  | -0,01      |
| MBSCAT 2, FTA                             | 0                     | 0                | 5.282                | -375             | 0             | 54.402               | -51.375          | -478                 | -0,14      |
| PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA                 | 0                     | 0                | 376.760              | -281.285         | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| PYME BANCAJA 5, FTA                       | 0                     | 0                | 1.698                | -530             | -897          | 14.675               | -17.710          | -26                  | -0,02      |
| PYME BANCAJA 7, FTA                       | 0                     | 0                | 4.311                | -2.269           | -2.327        | 30.580               | -53.126          | -34                  | -0,01      |
| PYME VALENCIA 1, FTA                      | 0                     | 0                | 2.500                | -1.046           | -799          | 17.265               | -18.409          | -27                  | -0,01      |
| PYME VALENCIA 2, FTA                      | 0                     | 0                | 2.608                | -1.026           | 0             | 22.508               | -27.570          | -19                  | -0,01      |
| PYMECAT 2 FTPYME, FTA                     | 0                     | 0                | 1.924                | -923             | -765          | 26.677               | -31.062          | -33                  | -0,02      |
| PYMECAT 3 FTPYME, FTA                     | 0                     | 0                | 6.492                | -1.129           | 0             | 76.557               | -83.835          | -25                  | -0,01      |
| PYMES BANESTO 2, FTA                      | 0                     | 0                | 2.966                | -902             | -1.876        | 35.046               | -35.789          | -25                  | -0,01      |
| RURAL CEDULA I, FTA                       | 0                     | -1               | 0                    | 0                | 0             | 0                    | 0                | 0                    | 0,00       |
| RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA           | 0                     | 0                | 6.664                | -2.290           | -3.880        | 23.846               | -25.371          | -484                 | -0,11      |
| RURAL HIPOTECARIO II FTH                  | 0                     | 0                | 412                  | -119             | 0             | 3.404                | -3.384           | -385                 | -1,48      |
| RURAL HIPOTECARIO III FTH                 | 0                     | 0                | 907                  | -213             | 0             | 5.132                | -4.881           | -1.013               | -1,79      |
| RURAL HIPOTECARIO IV FTH                  | 0                     | 0                | 1.700                | -462             | 0             | 7.810                | -7.729           | -1.707               | -1,54      |
| RURAL HIPOTECARIO IX, FTA                 | 0                     | 0                | 12.894               | -3.288           | -7.705        | 37.020               | -41.094          | -81                  | -0,01      |
| RURAL HIPOTECARIO V FTA                   | 0                     | 0                | 2.522                | -754             | 0             | 12.421               | -12.118          | -1.574               | -0,80      |
| RURAL HIPOTECARIO VI, FTA                 | 0                     | 0                | 4.762                | -1.388           | -2.767        | 18.724               | -18.915          | -444                 | -0,14      |
| RURAL HIPOTECARIO VII, FTA                | 0                     | 0                | 6.541                | -1.363           | -4.089        | 24.857               | -22.329          | -1.129               | -0,26      |
| RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA               | 0                     | 0                | 9.672                | -3.044           | -5.474        | 32.523               | -32.211          | -952                 | -0,14      |
| RURAL HIPOTECARIO X, FTA                  | 0                     | 0                | 19.532               | -5.565           | -12.092       | 52.698               | -55.461          | -170                 | -0,01      |
| RURAL HIPOTECARIO XI, FTA                 | 0                     | 0                | 24.072               | -6.520           | -14.657       | 62.800               | -65.337          | -904                 | -0,05      |
| RURAL HIPOTECARIO XII, FTA                | 0                     | 0                | 10.060               | -3.012           | -5.636        | 26.258               | -26.396          | -478                 | -0,06      |
| RURALPYME 1 FTPYME FTA                    | 0                     | 0                | 406                  | -181             | -229          | 3.350                | -3.686           | -12                  | -0,04      |
| RURALPYME 2 FTPYME FTA                    | 0                     | 0                | 2.913                | -575             | -1.179        | 19.048               | -16.707          | -18                  | -0,01      |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN 09-1, FTA        | 0                     | 0                | 6.725                | -1.935           | -4.622        | 50.595               | -68.128          | -275                 | -0,11      |
| SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2010-1, FTA | 0                     | 0                | 11.442               | -2.850           | -6.387        | 63.268               | -65.504          | -2.076               | -0,58      |

## Principales flujos de efectivo en el semestre - Fondos de titulización públicos

CUADRO C.1

| FONDO                        | ADQUISICIÓN / EMISIÓN |                  | INTERESES            |                  |               | AMORTIZACIONES       |                  | PAGOS COMISIONES (3) |            |
|------------------------------|-----------------------|------------------|----------------------|------------------|---------------|----------------------|------------------|----------------------|------------|
|                              | DCHOS CREDITO<br>(5)  | OBLIGACIONES (1) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | DERIVADOS (2) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | IMPORTE              | % / TA (4) |
| SANTANDER HIPOTECARIO I, FTA | 0                     | 0                | 8.004                | -2.878           | -3.493        | 28.364               | -28.623          | -1.831               | -0,28      |
| SOL-LION, FTA                | 0                     | 0                | 30.159               | -15.266          | -10.889       | 152.953              | -133.029         | -8.585               | -0,24      |
| TDA 11, FTH                  | 0                     | 0                | 1.003                | -298             | 0             | 6.923                | -7.036           | -761                 | -1,20      |
| TDA 12, FTH                  | 0                     | 0                | 989                  | -270             | 0             | 5.664                | -5.746           | -713                 | -1,23      |
| TDA 13 - MIXTO, FTA          | 0                     | 0                | 956                  | -264             | 0             | 4.905                | -4.556           | -696                 | -1,86      |
| TDA 14 - MIXTO, FTA          | 0                     | 0                | 2.012                | -521             | 0             | 7.863                | -7.117           | -1.430               | -1,28      |
| TDA 15 - MIXTO, FTA          | 0                     | 0                | 1.674                | -856             | 0             | 10.220               | -6.366           | -1.309               | -1,16      |
| TDA 16 - MIXTO, FTA          | 0                     | 0                | 1.832                | -429             | 0             | 10.334               | -11.387          | -1.202               | -0,89      |
| TDA 17 - MIXTO, FTA          | 0                     | 0                | 1.797                | -341             | 0             | 5.836                | -11.454          | -1.961               | -1,24      |
| TDA 18 - MIXTO, FTA          | 0                     | 0                | 2.053                | -454             | 0             | 5.754                | -5.527           | -1.261               | -0,87      |
| TDA 19 - MIXTO, FTA          | 0                     | 0                | 2.930                | -759             | -956          | 9.494                | -9.269           | -966                 | -0,51      |
| TDA 20 - MIXTO, FTA          | 0                     | 0                | 3.467                | -573             | -1.109        | 14.987               | -11.347          | -771                 | -0,53      |
| TDA 22 - MIXTO, FTA          | 0                     | 0                | 4.279                | -1.573           | -1.750        | 9.540                | -12.874          | -74                  | -0,04      |
| TDA 23, FTA                  | 0                     | 0                | 4.950                | -863             | -3.079        | 14.661               | -15.130          | -81                  | -0,03      |
| TDA 24, FTA                  | 0                     | 0                | 3.313                | -573             | -1.979        | 9.003                | -9.072           | -67                  | -0,03      |
| TDA 25, FTA                  | 0                     | 0                | 2.078                | -427             | -1.178        | 2.775                | -2.578           | -38                  | -0,03      |
| TDA 26 - MIXTO, FTA          | 0                     | 0                | 5.965                | -1.779           | -3.354        | 20.054               | -18.569          | -105                 | -0,03      |
| TDA 27, FTA                  | 0                     | 0                | 6.938                | -1.429           | -3.605        | 21.220               | -21.462          | -68                  | -0,01      |
| TDA 28, FTA                  | 0                     | 0                | 3.933                | -1.170           | -2.104        | 5.968                | -6.908           | -95                  | -0,03      |
| TDA 29, FTA                  | 0                     | 0                | 6.210                | -1.688           | -3.536        | 18.926               | -21.147          | -48                  | -0,01      |
| TDA 30, FTA                  | 0                     | 0                | 3.698                | -1.227           | -2.063        | 10.237               | -9.011           | -1.005               | -0,34      |
| TDA 31, FTA                  | 0                     | 0                | 2.589                | -807             | -1.345        | 8.593                | -9.497           | -26                  | -0,01      |
| TDA CAJAMAR 2, FTA           | 0                     | 0                | 5.848                | -1.327           | -3.216        | 17.936               | -18.479          | -368                 | -0,09      |
| TDA CAM 1, FTA               | 0                     | 0                | 3.765                | -861             | -2.013        | 16.722               | -17.626          | -282                 | -0,12      |
| TDA CAM 10, FTA              | 0                     | 0                | 11.168               | -3.088           | -5.619        | 61.795               | -67.827          | -81                  | -0,01      |
| TDA CAM 11, FTA              | 0                     | 0                | 17.108               | -5.882           | -6.411        | 46.333               | -63.216          | -148                 | -0,01      |
| TDA CAM 12, FTA              | 0                     | 0                | 20.087               | -6.912           | -7.577        | 56.925               | -73.754          | -174                 | -0,01      |
| TDA CAM 2, FTA               | 0                     | 0                | 4.122                | -1.184           | -2.373        | 17.275               | -18.781          | -256                 | -0,09      |
| TDA CAM 3, FTA               | 0                     | 0                | 4.657                | -1.334           | -2.497        | 21.835               | -23.342          | -412                 | -0,14      |

## Principales flujos de efectivo en el semestre - Fondos de titulización públicos

CUADRO C.1

| FONDO                                   | ADQUISICIÓN / EMISIÓN |                  | INTERESES            |                  |               | AMORTIZACIONES       |                  | PAGOS COMISIONES (3) |            |
|---|-----------------------|------------------|----------------------|------------------|---------------|----------------------|------------------|----------------------|------------|
|   | DCHOS CREDITO<br>(5)  | OBLIGACIONES (1) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | DERIVADOS (2) | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1) | IMPORTE              | % / TA (4) |
| TDA CAM 4, FTA                          | 0                     | 0                | 10.689               | -1.880           | -6.490        | 41.028               | -44.450          | -89                  | -0,01      |
| TDA CAM 5, FTA                          | 0                     | 0                | 13.605               | -3.472           | -7.806        | 43.722               | -48.860          | -97                  | -0,01      |
| TDA CAM 6, FTA                          | 0                     | 0                | 9.346                | -2.309           | -5.277        | 30.772               | -36.905          | -107                 | -0,02      |
| TDA CAM 7, FTA                          | 0                     | 0                | 13.791               | -3.129           | -7.751        | 47.751               | -56.157          | -100                 | -0,01      |
| TDA CAM 8, FTA                          | 0                     | 0                | 13.678               | -3.093           | -8.023        | 49.557               | -56.508          | -97                  | -0,01      |
| TDA CAM 9, FTA                          | 0                     | 0                | 12.479               | -3.412           | -6.731        | 42.248               | -52.365          | -91                  | -0,01      |
| TDA CORPORATIVOS I, FTA                 | 0                     | 0                | 3.151                | -3.736           | 908           | 72.066               | -122.789         | -46                  | -0,01      |
| TDA EMPRESAS 1, FTA                     | 0                     | 0                | 799                  | -640             | 0             | 12.956               | -13.056          | -36                  | -0,06      |
| TDA EMPRESAS 2, FTA                     | 0                     | 0                | 1.304                | -670             | 0             | 26.139               | -33.004          | -27                  | -0,02      |
| TDA FTPYME PASTOR 9, FTA                | 0                     | 0                | 5.257                | -2.275           | 0             | 46.160               | -51.802          | -28                  | -0,01      |
| TDA IBERCAJA 1, FTA                     | 0                     | 0                | 2.502                | -824             | -1.412        | 12.713               | -11.925          | -476                 | -0,26      |
| TDA IBERCAJA 2, FTA                     | 0                     | 0                | 4.871                | -1.622           | -2.782        | 21.331               | -19.191          | -887                 | -0,21      |
| TDA IBERCAJA 3, FTA                     | 0                     | 0                | 5.425                | -1.608           | -3.011        | 24.703               | -23.249          | -930                 | -0,19      |
| TDA IBERCAJA 4, FTA                     | 0                     | 0                | 8.049                | -2.742           | -4.622        | 37.668               | -32.775          | -1.055               | -0,14      |
| TDA IBERCAJA 5, FTA                     | 0                     | 0                | 7.731                | -2.581           | -4.460        | 32.370               | -29.914          | -902                 | -0,12      |
| TDA IBERCAJA 6, FTA                     | 0                     | 0                | 10.945               | -4.631           | -6.506        | 47.459               | -45.643          | -114                 | -0,01      |
| TDA IBERCAJA 7, FTA                     | 0                     | 0                | 16.313               | -8.001           | -8.781        | 56.922               | -48.978          | -984                 | -0,06      |
| TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH             | 0                     | 0                | 5.341                | -2.307           | -2.544        | 15.162               | -13.382          | -40                  | -0,01      |
| TDA LICO LEASING III, FTA               | -137.000              | 137.000          | 1.489                | 0                | 0             | 13.545               | 0                | 0                    | 0,00       |
| TDA PASTOR 1, FTA                       | 0                     | 0                | 1.837                | -385             | -766          | 8.900                | -7.247           | -511                 | -0,49      |
| TDA PASTOR CONSUMO 1, FTA               | 0                     | 0                | 1.114                | -196             | -892          | 10.787               | -11.563          | -31                  | -0,10      |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA           | 0                     | 0                | 705                  | -440             | -448          | 7.758                | -9.380           | -27                  | -0,04      |
| TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA           | 0                     | 0                | 1.606                | -755             | -811          | 14.957               | -16.701          | -91                  | -0,05      |
| TDA TARRAGONA 1, FTA                    | 0                     | 0                | 4.480                | -1.223           | -2.204        | 7.716                | -10.003          | -25                  | -0,01      |
| UNICAJA ANDALUCIA FTVIVIENDA TDA 1, FTA | 0                     | 0                | 2.368                | -698             | -1.153        | 8.653                | -7.795           | -100                 | -0,06      |
| UNICAJA AYT EMPRESAS I, FTA             | 0                     | 0                | 1.926                | -792             | -541          | 10.648               | -12.293          | -113                 | -0,07      |
| UNICAJA TDA VPO, FTA                    | 0                     | 0                | 2.359                | -728             | -999          | 5.392                | -5.618           | -128                 | -0,08      |
| VAL BANCAJA 1, FTA                      | 0                     | 0                | 3.047                | -1.100           | 0             | 7.944                | -9.668           | -24                  | -0,01      |
| VALENCIA HIPOTECARIO 1, FTA             | 0                     | 0                | 1.920                | -515             | -1.136        | 10.135               | -9.724           | -206                 | -0,14      |

## Principales flujos de efectivo en el semestre - Fondos de titulización públicos

CUADRO C.1

| FONDO                          | ADQUISICIÓN / EMISIÓN |                   | INTERESES            |                   |                   | AMORTIZACIONES       |                    | PAGOS COMISIONES (3) |                |
|--------------------------------|-----------------------|-------------------|----------------------|-------------------|-------------------|----------------------|--------------------|----------------------|----------------|
|                                | DCHOS CREDITO<br>(5)  | OBLIGACIONES (1)  | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1)  | DERIVADOS (2)     | DCHOS CREDITO<br>(5) | OBLIGACIONES (1)   | IMPORTE              | % / TA (4)     |
| VALENCIA HIPOTECARIO 2, FTH    | 0                     | 0                 | 5.166                | -1.830            | -2.556            | 24.605               | -22.729            | -548                 | -0,12          |
| VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA    | 0                     | 0                 | 6.241                | -1.554            | -3.094            | 25.465               | -26.527            | -48                  | -0,01          |
| VALENCIA HIPOTECARIO 4, FTA    | 0                     | 0                 | 7.499                | -3.403            | -3.595            | 27.495               | -23.731            | -56                  | -0,01          |
| VALENCIA HIPOTECARIO 5, FTA    | 0                     | 0                 | 4.680                | -1.703            | -2.362            | 15.942               | -15.651            | -35                  | -0,01          |
| <b>Subtotal BONOS 2012 2</b>   | <b>-12.547.857</b>    | <b>13.420.336</b> | <b>4.603.475</b>     | <b>-2.769.671</b> | <b>-1.120.272</b> | <b>26.416.251</b>    | <b>-29.042.494</b> | <b>-235.549</b>      | <b>-0,07</b>   |
| <b>Subtotal BONOS 2011 2</b>   | <b>-28.474.309</b>    | <b>31.662.328</b> | <b>5.918.200</b>     | <b>-4.264.564</b> | <b>-370.306</b>   | <b>29.575.684</b>    | <b>-28.988.160</b> | <b>-344.863</b>      | <b>-0,08</b>   |
| <b>%Variación</b>              | <b>-55,93</b>         | <b>-57,61</b>     | <b>-22,21</b>        | <b>-35,05</b>     | <b>202,53</b>     | <b>-10,68</b>        | <b>0,19</b>        | <b>-31,70</b>        | <b>-12,50</b>  |
| <b>PAGARÉS</b>                 |                       |                   |                      |                   |                   |                      |                    |                      |                |
| FTA SANTANDER 2                | -4.537.557            | 658.000           | -462                 | 0                 | 0                 | 4.809.312            | -577.000           | -14                  | 0,00           |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2012 2</b> | <b>-4.537.557</b>     | <b>658.000</b>    | <b>-462</b>          | <b>0</b>          | <b>0</b>          | <b>4.809.312</b>     | <b>-577.000</b>    | <b>-14</b>           | <b>0,00</b>    |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2011 2</b> | <b>-5.173.349</b>     | <b>895.059</b>    | <b>-302</b>          | <b>-371</b>       | <b>0</b>          | <b>5.678.308</b>     | <b>-1.919.273</b>  | <b>8.469</b>         | <b>0,50</b>    |
| <b>%Variación</b>              | <b>-12,29</b>         | <b>-26,49</b>     | <b>52,98</b>         | <b>-100,00</b>    | <b>-</b>          | <b>-15,30</b>        | <b>-69,94</b>      | <b>-100,17</b>       | <b>-100,00</b> |
| <b>Total 2012 2</b>            | <b>-17.085.414</b>    | <b>14.078.336</b> | <b>4.603.013</b>     | <b>-2.769.671</b> | <b>-1.120.272</b> | <b>31.225.563</b>    | <b>-29.619.494</b> | <b>-235.563</b>      | <b>-0,07</b>   |
| <b>Total 2011 2</b>            | <b>-33.647.658</b>    | <b>32.557.387</b> | <b>5.917.898</b>     | <b>-4.264.935</b> | <b>-370.306</b>   | <b>35.253.992</b>    | <b>-30.907.433</b> | <b>-336.394</b>      | <b>-0,08</b>   |
| <b>%Variación</b>              | <b>-49,22</b>         | <b>-56,76</b>     | <b>-22,22</b>        | <b>-35,06</b>     | <b>202,53</b>     | <b>-11,43</b>        | <b>-4,17</b>       | <b>-29,97</b>        | <b>-12,50</b>  |

Nota: Importes en miles de euros

(1) Obligaciones y otros valores negociables

(2) Cobros pagos por operaciones de derivados

(3) Pagos por comisiones y otros servicios financieros

(4) Porcentaje que representan dichos pagos sobre el total activo

(5) Derechos de crédito

| FONDO                                 | ADQUISICIÓN / EMISIÓN |                  | INTERESES         |                  |                | AMORTIZACIONES    |                  | PAGOS COMISIONES (3) |               |
|---------------------------------------|-----------------------|------------------|-------------------|------------------|----------------|-------------------|------------------|----------------------|---------------|
|                                       | DCHOS CREDITO (5)     | OBLIGACIONES (1) | DCHOS CREDITO (5) | OBLIGACIONES (1) | DERIVADOS (2)  | DCHOS CREDITO (5) | OBLIGACIONES (1) | IMPORTE              | % / TA (4)    |
| <b>BONOS</b>                          |                       |                  |                   |                  |                |                   |                  |                      |               |
| AYT ADMINISTRACIONES I, FTA           | 0                     | 0                | 6.533             | -6.533           | 0              | 9.876             | -9.876           | -42                  | -0,03         |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES II, FTA  | 0                     | 0                | 2.772             | -2.772           | 0              | 0                 | 0                | 0                    | 0,00          |
| AYT FINANCIACION INVERSIONES III, FTA | 0                     | 0                | 9.384             | -4.492           | -4.875         | 0                 | 0                | -5                   | 0,00          |
| AYT LICO LEASING I, FTA               | 0                     | 0                | 3.302             | -1.266           | -1.806         | 46.585            | -66.000          | -815                 | -1,26         |
| AYT PRESTIGE CAJAS DE AHORRO, FTA     | 0                     | 0                | 1.424             | -1.424           | 0              | 0                 | 0                | -28                  | -0,02         |
| AYT.10, FINANCIACION INVERSIONES, FTA | 0                     | 0                | 6.670             | -3.785           | -2.882         | 0                 | 0                | -4                   | 0,00          |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA N° 2,FTA  | 0                     | 0                | 2.859             | 0                | 0              | 13.290            | -16.841          | -128                 | -0,93         |
| BANCO FINANTIA SOFINLOC TDA N° 3, FTA | 0                     | 0                | 2.820             | -375             | 0              | 15.621            | -18.009          | -143                 | -0,85         |
| CAJA SAN FERNANDO CDO I, FTA          | 0                     | 0                | 1.608             | -1.127           | 20             | 12.431            | -12.436          | -60                  | -0,12         |
| CAP-TDA 2, FTA                        | -1.168.738            | 0                | 0                 | -4.970           | 0              | 1.187.029         | 0                | -78                  | -0,02         |
| EMPRESAS TDA CAM 10, FTA              | 0                     | 0                | 20.686            | -10.951          | 0              | 219.618           | -219.719         | -6.555               | -1,18         |
| GC COMPASS SPAIN 2, FTA               | -1.377.282            | 1.377.282        | 0                 | -1.696           | 0              | 0                 | 0                | -107                 | -0,18         |
| MORTGAGE FINANCE SPAIN, FTA           | 0                     | 0                | 3.439             | -3.349           | 0              | 2.158             | -2.158           | -87                  | -0,04         |
| SOFINLOC ESPAÑA TDA N° 1, FTA         | 0                     | 0                | 2.985             | -644             | 0              | 7.202             | -9.394           | -243                 | -0,84         |
| TDA FS1, FTA                          | 0                     | 0                | 7.526             | -2.025           | -5.398         | 36.447            | -36.447          | -125                 | -0,10         |
| VALENCIA ACTIVOS 1, FTA               | -1.313.390            | 1.313.000        | 31.080            | -14.902          | 0              | 508.928           | -359.655         | -5.144               | -0,48         |
| <b>Subtotal BONOS 2012 2</b>          | <b>-3.859.410</b>     | <b>2.690.282</b> | <b>103.088</b>    | <b>-60.311</b>   | <b>-14.941</b> | <b>2.059.185</b>  | <b>-750.535</b>  | <b>-13.564</b>       | <b>-0,36</b>  |
| <b>Subtotal BONOS 2011 2</b>          | <b>-3.770.060</b>     | <b>2.568.201</b> | <b>66.193</b>     | <b>-44.024</b>   | <b>-16.812</b> | <b>1.429.436</b>  | <b>-217.689</b>  | <b>-2.887</b>        | <b>-0,09</b>  |
| <b>%Variación</b>                     | <b>2,37</b>           | <b>4,75</b>      | <b>55,74</b>      | <b>37,00</b>     | <b>-11,13</b>  | <b>44,06</b>      | <b>244,77</b>    | <b>369,83</b>        | <b>300,00</b> |
| <b>PAGARÉS</b>                        |                       |                  |                   |                  |                |                   |                  |                      |               |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2012 2</b>        | <b>0</b>              | <b>0</b>         | <b>0</b>          | <b>0</b>         | <b>0</b>       | <b>0</b>          | <b>0</b>         | <b>0</b>             | <b>0,00</b>   |
| <b>Subtotal PAGARÉS 2011 2</b>        | <b>-1.514.171</b>     | <b>-7.472</b>    | <b>12.151</b>     | <b>0</b>         | <b>0</b>       | <b>1.511.714</b>  | <b>0</b>         | <b>0</b>             | <b>0,00</b>   |
| <b>%Variación</b>                     | <b>-100,00</b>        | <b>-100,00</b>   | <b>-100,00</b>    | <b>-</b>         | <b>-</b>       | <b>-100,00</b>    | <b>-</b>         | <b>-</b>             | <b>-</b>      |
| <b>Total 2012 2</b>                   | <b>-3.859.410</b>     | <b>2.690.282</b> | <b>103.088</b>    | <b>-60.311</b>   | <b>-14.941</b> | <b>2.059.185</b>  | <b>-750.535</b>  | <b>-13.564</b>       | <b>-0,36</b>  |
| <b>Total 2011 2</b>                   | <b>-5.284.231</b>     | <b>2.560.729</b> | <b>78.344</b>     | <b>-44.024</b>   | <b>-16.812</b> | <b>2.941.150</b>  | <b>-217.689</b>  | <b>-2.887</b>        | <b>-0,08</b>  |
| <b>%Variación</b>                     | <b>-26,96</b>         | <b>5,06</b>      | <b>31,58</b>      | <b>37,00</b>     | <b>-11,13</b>  | <b>-29,99</b>     | <b>244,77</b>    | <b>369,83</b>        | <b>350,00</b> |

Nota: Importes en miles de euros

(1) Obligaciones y otros valores negociables

(2) Cobros pagos por operaciones de derivados

(3) Pagos por comisiones y otros servicios financieros

(4) Porcentaje que representan dichos pagos sobre el total activo

(5) Derechos de crédito