



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

Ejercicio 2023

ÍNDICE

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
 - F NUMERO DE FONDOS
-

INFORMACIÓN POR FONDO

- 00 FONDOS DE TITULIZACIÓN - INFORMACIÓN GENERAL
 - A.1 PRINCIPALES MAGNITUDES DE BALANCE
 - A.1.1 IMPORTE PENDIENTE DERECHOS DE CRÉDITO
 - A.1.2 INFORMACIÓN DERECHOS DE CRÉDITO
 - A.1.3 INFORMACIÓN OBLIGACIONES Y OTROS VALORES NEGOCIABLES
 - B.1 PRINCIPALES MAGNITUDES DE RESULTADOS EN EL EJERCICIO
 - B.1.1 MARGEN DE INTERESES
 - B.1.2 COMISIONES
 - C.1 PRINCIPALES FLUJOS DE EFECTIVO EN EL EJERCICIO
-

Miles de euros	31/12/2023					31/12/2022					% VARIACIÓN TOTAL FONDOS
	BONOS/ F. PÚBLICOS	PAGARÉS/ F. PÚBLICOS	TOTAL F. PÚBLICOS	F. PRIVADOS	TOTAL FONDOS	BONOS/ F. PÚBLICOS	PAGARÉS/ F. PÚBLICOS	TOTAL F. PÚBLICOS	F. PRIVADOS	TOTAL FONDOS	
ACTIVO											
A) ACTIVO NO CORRIENTE	111.378.410	-	111.378.410	3.705.822	115.084.232	118.402.145	-	118.402.145	3.707.528	122.109.673	-5,75
I. Activos financieros a largo plazo	111.378.410	-	111.378.410	3.704.603	115.083.013	118.402.145	-	118.402.145	3.706.007	122.108.152	-5,75
1. Activos titulizados	109.740.830	-	109.740.830	3.130.057	112.870.887	116.751.315	-	116.751.315	3.427.075	120.178.390	-6,08
1.1 Participaciones hipotecarias	12.845.007	-	12.845.007	0	12.845.007	15.733.045	-	15.733.045	4.690	15.737.735	-18,38
1.2 Certificados de transmisión de hipoteca	59.581.483	-	59.581.483	213.739	59.795.222	66.702.854	-	66.702.854	198.233	66.901.087	-10,62
1.3 Préstamos hipotecarios	197.937	-	197.937	0	197.937	99.968	-	99.968	0	99.968	98,00
1.4 Cédulas hipotecarias	11.660.000	-	11.660.000	0	11.660.000	11.660.000	-	11.660.000	0	11.660.000	0,00
1.5 Préstamos a promotores	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.6 Préstamos a PYMES	5.192.594	-	5.192.594	96.419	5.289.013	4.315.945	-	4.315.945	62.349	4.378.294	20,80
1.7 Préstamos a empresas	13.590	-	13.590	471.101	484.691	18.019	-	18.019	472.950	490.969	-1,28
1.8 Préstamos corporativos	0	-	0	175.316	175.316	0	-	0	368.218	368.218	-52,39
1.9 Cédulas territoriales	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.10 Bonos de tesorería	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.11 Deuda subordinada	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.12 Créditos AAPP	0	-	0	9.876	9.876	0	-	0	19.753	19.753	-50,00
1.13 Préstamos consumo	7.435.900	-	7.435.900	416.523	7.852.423	5.138.887	-	5.138.887	326.622	5.465.509	43,67
1.14 Préstamos automoción	5.202.842	-	5.202.842	0	5.202.842	5.301.017	-	5.301.017	0	5.301.017	-1,85
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	1.805.073	-	1.805.073	0	1.805.073	266.096	-	266.096	0	266.096	578,35
1.16 Cuentas a cobrar	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.17 Derechos de crédito futuros	0	-	0	652.356	652.356	0	-	0	289.794	289.794	125,11
1.18 Bonos de titulización	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.19 Cédulas internacionalización	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.20 Otros	4.697.705	-	4.697.705	561.028	5.258.733	6.593.350	-	6.593.350	519.973	7.113.323	-26,07
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0	-	0	3.747	3.747	0	-	0	2.928	2.928	27,97
1.22 Activos dudosos -principal-	1.393.472	-	1.393.472	686.444	2.079.916	1.176.842	-	1.176.842	1.377.684	2.554.526	-18,58
1.23 Activos dudosos -intereses-	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	-284.772	-	-284.772	-156.493	-441.265	-254.707	-	-254.707	-216.119	-470.826	-6,28
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2. Derivados	1.592.262	-	1.592.262	3.641	1.595.903	1.565.768	-	1.565.768	5.588	1.571.356	1,56
2.1 Derivados de cobertura	1.592.262	-	1.592.262	3.641	1.595.903	1.205.775	-	1.205.775	5.588	1.211.363	31,74
2.2 Derivados de negociación	0	-	0	0	0	359.992	-	359.992	0	359.992	-100,00
3. Otros activos financieros	45.319	-	45.319	570.904	616.223	85.062	-	85.062	273.344	358.406	71,93
3.1 Valores representativos de deuda	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
3.2 Instrumentos de patrimonio	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
3.3 Garantías financieras	120	-	120	0	120	120	-	120	0	120	0,00
3.4 Otros	45.199	-	45.199	570.904	616.103	84.942	-	84.942	273.344	358.286	71,96
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
II. Activos por impuesto diferido	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
III. Otros activos no corrientes	0	-	0	1.220	1.220	0	-	0	1.521	1.521	-19,79

Miles de euros	31/12/2023					31/12/2022					% VARIACIÓN TOTAL FONDOS
	BONOS/ F. PÚBLICOS	PAGARÉS/ F. PÚBLICOS	TOTAL F. PÚBLICOS	F. PRIVADOS	TOTAL FONDOS	BONOS/ F. PÚBLICOS	PAGARÉS/ F. PÚBLICOS	TOTAL F. PÚBLICOS	F. PRIVADOS	TOTAL FONDOS	
B) ACTIVO CORRIENTE	29.251.036	-	29.251.036	3.014.159	32.265.195	29.020.166	-	29.020.166	2.798.396	31.818.562	1,40
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	365.129	-	365.129	0	365.129	408.299	-	408.299	0	408.299	-10,57
V. Activos financieros a corto plazo	19.935.886	-	19.935.886	1.986.336	21.922.222	19.773.565	-	19.773.565	1.665.563	21.439.128	2,25
1. Activos titulizados	18.291.604	-	18.291.604	1.606.958	19.898.562	18.144.240	-	18.144.240	1.596.525	19.740.765	0,80
1.1 Participaciones hipotecarias	1.776.976	-	1.776.976	12.720	1.789.696	1.633.392	-	1.633.392	8.246	1.641.638	9,02
1.2 Certificados de transmisión de hipoteca	4.382.765	-	4.382.765	61.704	4.444.469	4.262.378	-	4.262.378	56.381	4.318.759	2,91
1.3 Préstamos hipotecarios	14.616	-	14.616	0	14.616	11.972	-	11.972	0	11.972	22,08
1.4 Cédulas hipotecarias	0	-	0	0	0	1.600.000	-	1.600.000	0	1.600.000	-100,00
1.5 Préstamos a promotores	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.6 Préstamos a PYMES	1.845.449	-	1.845.449	22.940	1.868.389	1.930.209	-	1.930.209	12.627	1.942.836	-3,83
1.7 Préstamos a empresas	3.176	-	3.176	53.352	56.528	3.890	-	3.890	1.454	5.344	957,78
1.8 Préstamos corporativos	0	-	0	25.737	25.737	0	-	0	324.654	324.654	-92,07
1.9 Cédulas territoriales	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.10 Bonos de tesorería	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.11 Deuda subordinada	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.12 Créditos AAPP	0	-	0	9.876	9.876	0	-	0	9.876	9.876	0,00
1.13 Préstamos consumo	3.613.266	-	3.613.266	145.623	3.758.889	2.919.902	-	2.919.902	92.877	3.012.779	24,76
1.14 Préstamos automoción	2.875.778	-	2.875.778	0	2.875.778	2.757.829	-	2.757.829	0	2.757.829	4,28
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	765.376	-	765.376	0	765.376	137.297	-	137.297	0	137.297	457,46
1.16 Cuentas a cobrar	0	-	0	42.001	42.001	0	-	0	39.287	39.287	6,91
1.17 Derechos de crédito futuros	0	-	0	21.442	21.442	0	-	0	30.665	30.665	-30,08
1.18 Bonos de titulización	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.19 Cédulas internacionalización	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.20 Otros	1.893.594	-	1.893.594	386.552	2.280.146	1.867.327	-	1.867.327	346.919	2.214.246	2,98
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	572.063	-	572.063	15.599	587.662	474.467	-	474.467	8.185	482.652	21,76
1.22 Intereses vencidos e impagados	19.150	-	19.150	549	19.699	12.199	-	12.199	145	12.344	59,58
1.23 Activos dudosos -principal-	956.950	-	956.950	860.926	1.817.876	944.391	-	944.391	715.044	1.659.435	9,55
1.24 Activos dudosos -intereses-	35.900	-	35.900	7.409	43.309	31.394	-	31.394	5.881	37.275	16,19
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	-463.456	-	-463.456	-59.475	-522.931	-442.407	-	-442.407	-55.717	-498.124	4,98
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2. Derivados	358.765	-	358.765	0	358.765	428.826	-	428.826	0	428.826	-16,34
2.1 Derivados de cobertura	358.765	-	358.765	0	358.765	428.826	-	428.826	0	428.826	-16,34
2.2 Derivados de negociación	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
3. Otros activos financieros	1.285.516	-	1.285.516	379.378	1.664.894	1.200.499	-	1.200.499	69.039	1.269.538	31,14
3.1 Valores representativos de deuda	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
3.2 Instrumentos de patrimonio	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	1.260.971	-	1.260.971	9.672	1.270.643	1.177.483	-	1.177.483	8.740	1.186.223	7,12
3.4 Garantías financieras	3	-	3	0	3	3	-	3	0	3	0,00
3.5 Otros	24.543	-	24.543	369.705	394.248	23.013	-	23.013	60.299	83.312	373,22
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
VI. Ajustes por periodificaciones	5.164	-	5.164	7.473	12.637	4.855	-	4.855	7.794	12.649	-0,09
1. Comisiones	162	-	162	0	162	148	-	148	0	148	9,46
2. Otros	5.002	-	5.002	7.473	12.475	4.707	-	4.707	7.794	12.501	-0,21
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	8.944.857	-	8.944.857	1.020.351	9.965.208	8.833.446	-	8.833.446	1.125.038	9.958.484	0,07
1. Tesorería	8.944.857	-	8.944.857	1.020.351	9.965.208	8.833.446	-	8.833.446	1.125.038	9.958.484	0,07
2. Otros activos líquidos equivalentes	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
TOTAL ACTIVO	140.629.446	-	140.629.446	6.719.983	147.349.429	147.422.311	-	147.422.311	6.505.924	153.928.235	-4,27

Miles de euros	31/12/2023					31/12/2022					% VARIACIÓN TOTAL FONDOS
	BONOS/ F. PÚBLICOS	PAGARÉS/ F. PÚBLICOS	TOTAL F. PÚBLICOS	F. PRIVADOS	TOTAL FONDOS	BONOS/ F. PÚBLICOS	PAGARÉS/ F. PÚBLICOS	TOTAL F. PÚBLICOS	F. PRIVADOS	TOTAL FONDOS	
PASIVO											-
A) PASIVO NO CORRIENTE	120.117.184	-	120.117.184	4.942.259	125.059.443	125.302.327	-	125.302.327	4.835.671	130.137.998	-3,90
I. Provisiones a largo plazo	989.847	-	989.847	97.433	1.087.280	940.628	-	940.628	61.492	1.002.120	8,50
1. Provisión garantías financieras	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2. Provisión por margen de intermediación	989.847	-	989.847	97.433	1.087.280	940.628	-	940.628	61.492	1.002.120	8,50
3. Otras provisiones	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
II. Pasivos financieros a largo plazo	119.127.337	-	119.127.337	4.844.826	123.972.163	124.361.699	-	124.361.699	4.774.179	129.135.878	-4,00
1. Obligaciones y otros valores emitidos	111.729.038	-	111.729.038	4.224.032	115.953.070	118.600.810	-	118.600.810	4.365.928	122.966.738	-5,70
1.1 Series no subordinadas	86.391.311	-	86.391.311	4.182.307	90.573.618	92.518.468	-	92.518.468	4.476.583	96.995.051	-6,62
1.2 Series subordinadas	26.045.855	-	26.045.855	285.013	26.330.868	26.766.333	-	26.766.333	812.492	27.578.825	-4,53
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	-708.128	-	-708.128	-243.286	-951.414	-683.991	-	-683.991	-923.147	-1.607.138	-40,80
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2. Deudas con entidades de crédito	7.035.670	-	7.035.670	273.694	7.309.364	5.530.969	-	5.530.969	124.802	5.655.771	29,24
2.1 Préstamo subordinado	5.767.996	-	5.767.996	274.143	6.042.139	5.571.144	-	5.571.144	123.525	5.694.669	6,10
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	1.895.322	-	1.895.322	164	1.895.486	263.749	-	263.749	1.427	265.176	614,80
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	289.524	-	289.524	0	289.524	450.225	-	450.225	0	450.225	-35,69
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	-917.172	-	-917.172	-802	-917.974	-754.149	-	-754.149	-150	-754.299	21,70
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0	-	0	189	189	0	-	0	0	0	-
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
3. Derivados	288.652	-	288.652	74.911	363.563	114.055	-	114.055	0	114.055	218,76
3.1 Derivados de cobertura	288.652	-	288.652	74.911	363.563	114.055	-	114.055	0	114.055	218,76
3.2 Derivados de negociación	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
4. Otros pasivos financieros	73.977	-	73.977	272.189	346.166	115.863	-	115.863	283.448	399.311	-13,31
4.1 Garantías financieras	13.873	-	13.873	85.611	99.484	16.837	-	16.837	93.291	110.128	-9,67
4.1 Otros	60.104	-	60.104	187.639	247.743	99.027	-	99.027	191.434	290.461	-14,71
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0	-	0	-1.062	-1.062	0	-	0	-1.277	-1.277	-16,84
III. Pasivos por impuesto diferido	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-

Miles de euros	31/12/2023					31/12/2022					% VARIACIÓN TOTAL FONDOS
	BONOS/ F. PÚBLICOS	PAGARÉS/ F. PÚBLICOS	TOTAL F. PÚBLICOS	F. PRIVADOS	TOTAL FONDOS	BONOS/ F. PÚBLICOS	PAGARÉS/ F. PÚBLICOS	TOTAL F. PÚBLICOS	F. PRIVADOS	TOTAL FONDOS	
B) PASIVO CORRIENTE	18.864.368	-	18.864.368	1.848.994	20.713.362	20.287.308	-	20.287.308	1.664.664	21.951.972	-5,64
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	20	-	20	0	20	182	-	182	0	182	-89,01
V. Provisiones a corto plazo	0	-	0	0	0	545	-	545	0	545	-100,00
1. Provisión garantías financieras	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2. Provisión por margen de intermediación	0	-	0	0	0	545	-	545	0	545	-100,00
3. Otras provisiones	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
VI. Pasivos financieros a corto plazo	18.279.879	-	18.279.879	1.786.740	20.066.619	19.689.823	-	19.689.823	1.606.829	21.296.652	-5,78
1. Obligaciones y otros valores emitidos	17.213.400	-	17.213.400	1.572.870	18.786.270	18.877.577	-	18.877.577	1.379.150	20.256.727	-7,26
1.1 Series no subordinadas	14.404.865	-	14.404.865	1.767.506	16.172.371	16.784.107	-	16.784.107	1.398.123	18.182.230	-11,05
1.2 Series subordinadas	1.799.341	-	1.799.341	541.508	2.340.849	1.314.434	-	1.314.434	0	1.314.434	78,09
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	-197.856	-	-197.856	-2.702.563	-2.900.419	-107.923	-	-107.923	-1.741.346	-1.849.269	56,84
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	758.980	-	758.980	44.428	803.408	606.400	-	606.400	25.624	632.024	27,12
1.5 Intereses vencidos e impagados	448.070	-	448.070	1.921.992	2.370.062	280.557	-	280.557	1.696.748	1.977.305	19,86
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2. Deudas con entidades de crédito	795.380	-	795.380	2.614	797.994	508.083	-	508.083	2.613	510.696	56,26
2.1 Préstamo subordinado	510.315	-	510.315	362	510.677	416.292	-	416.292	580	416.872	22,50
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	530	-	530	1.177	1.707	24.356	-	24.356	51	24.407	-93,01
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	162.957	-	162.957	569	163.526	46.020	-	46.020	695	46.715	250,05
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	-381.842	-	-381.842	-1.150	-382.992	-335.145	-	-335.145	-545	-335.690	14,09
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	36.107	-	36.107	1.603	37.710	20.699	-	20.699	1.764	22.463	67,88
2.6 Intereses vencidos e impagados	467.313	-	467.313	55	467.368	335.863	-	335.863	67	335.930	39,13
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
3. Derivados	19.121	-	19.121	3.704	22.825	7.854	-	7.854	2.915	10.769	111,95
3.1 Derivados de cobertura	19.121	-	19.121	3.704	22.825	7.854	-	7.854	2.915	10.769	111,95
3.2 Derivados de negociación	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
4. Otros pasivos financieros	251.978	-	251.978	207.550	459.528	296.310	-	296.310	222.152	518.462	-11,37
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	185.140	-	185.140	142.906	328.046	187.837	-	187.837	160.933	348.770	-5,94
4.2 Garantías financieras	0	-	0	53.118	53.118	0	-	0	57.772	57.772	-8,06
4.3 Otros	66.838	-	66.838	11.526	78.364	108.473	-	108.473	3.447	111.920	-29,98
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
VII. Ajustes por periodificaciones	584.470	-	584.470	62.254	646.724	596.758	-	596.758	57.835	654.593	-1,20
1. Comisiones	558.469	-	558.469	26.429	584.898	549.095	-	549.095	14.615	563.710	3,76
1.1 Comisión sociedad gestora	1.753	-	1.753	588	2.341	1.740	-	1.740	329	2.069	13,15
1.2 Comisión administrador	28.153	-	28.153	1.557	29.710	26.465	-	26.465	434	26.899	10,45
1.3 Comisión agente financiero/pagos	251	-	251	66	317	264	-	264	33	297	6,73
1.4 Comisión variable	829.927	-	829.927	25.813	855.740	793.377	-	793.377	13.781	807.158	6,02
1.5 Otras comisiones del cedente	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	-301.907	-	-301.907	-2.082	-303.989	-273.067	-	-273.067	-281	-273.348	11,21
1.7 Otras comisiones	291	-	291	487	778	315	-	315	320	635	22,52
2. Otros	26.000	-	26.000	35.825	61.825	47.663	-	47.663	43.219	90.882	-31,97
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	1.647.893	-	1.647.893	-71.270	1.576.623	1.832.676	-	1.832.676	5.588	1.838.264	-14,23
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
IX. Coberturas de flujos de efectivo	1.647.893	-	1.647.893	-71.270	1.576.623	1.832.676	-	1.832.676	5.588	1.838.264	-14,23
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
TOTAL PASIVO	140.629.446	-	140.629.446	6.719.983	147.349.429	147.422.311	-	147.422.311	6.505.923	153.928.234	-4,27

	BONOS/ F. PÚBLICOS			PAGARÉS/ F. PÚBLICOS			F. PRIVADOS			TOTAL		
	2023	2022	%	2023	2022	%	2023	2022	%	2023	2022	%
Miles de euros												
1. Intereses y rendimientos asimilados	5.325.432	3.071.258	73,40	0	0	-	608.096	303.150	100,59	5.933.528	3.374.408	75,84
1.1 Activos titulizados	5.081.964	3.012.374	68,70	0	0	-	526.035	252.290	108,50	5.607.999	3.264.664	71,78
1.2 Otros activos financieros	243.468	58.883	313,48	0	0	-	82.063	50.859	61,35	325.531	109.742	196,63
2. Intereses y cargas asimilados	-4.873.573	-1.573.850	209,66	0	0	-	-729.464	-398.887	82,87	-5.603.037	-1.972.737	184,02
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	-4.491.893	-1.428.653	214,41	0	0	-	-710.869	-390.663	81,96	-5.202.762	-1.819.316	185,97
2.2 Deudas con entidades de crédito	-348.778	-124.083	181,08	0	0	-	-13.309	-6.250	112,94	-362.087	-130.333	177,82
2.3 Otros pasivos financieros	-32.903	-21.116	55,82	0	0	-	-5.285	-1.975	167,59	-38.188	-23.091	65,38
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	594.366	5.004	-	0	0	-	1.171	-916	-	595.537	4.088	-
A) MARGEN DE INTERESES	1.046.225	1.502.412	-30,36	0	0	-	-120.195	-96.654	-24,36	926.030	1.405.758	-34,13
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	-8.426	-13.128	35,82	0	0	-	7.612	95	-	-814	-13.033	93,75
4.1 Resultados de derivados de negociación	0	0	-	0	0	-	0	0	-	0	0	-
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0	0	-	0	0	-	7.428	0	-	7.428	0	-
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0	0	-	0	0	-	0	0	-	0	0	-
4.4 Otros	-8.426	-13.128	35,82	0	0	-	185	95	94,74	-8.241	-13.033	36,77
5. Diferencias de cambio (neto)	0	0	-	0	0	-	7.668	0	-	7.668	0	-
6. Otros ingresos de explotación	1.200	5.702	-78,95	0	0	-	5.540	3.750	47,73	6.740	9.452	-28,69
7. Otros gastos de explotación	-1.093.517	-1.398.039	-21,78	0	0	-	-172.988	-92.050	87,93	-1.266.505	-1.490.089	-15,00
7.1 Servicios exteriores	-30.493	-24.163	26,20	0	0	-	-27.970	-17.658	58,40	-58.463	-41.821	39,79
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	-24.820	-18.827	31,83	0	0	-	-20.114	-10.735	87,37	-44.934	-29.562	52,00
7.1.2 Servicios bancarios y similares	-1.378	-1.817	-24,16	0	0	-	-3.548	-928	282,33	-4.926	-2.745	79,45
7.1.3 Publicidad y propaganda	0	-1	-100,00	0	0	-	0	0	-	0	-1	-100,00
7.1.4 Otros servicios	-4.295	-3.517	22,12	0	0	-	-4.307	-5.996	-28,17	-8.602	-9.513	-9,58
7.2 Tributos	-373	-393	-5,09	0	0	-	-30	-29	3,45	-403	-422	-4,50
7.3 Otros gastos de gestión corriente	-1.062.651	-1.373.484	-22,63	0	0	-	-144.989	-74.362	94,98	-1.207.640	-1.447.846	-16,59
7.3.1 Comisión sociedad gestora	-18.660	-18.822	-0,86	0	0	-	-6.171	-5.276	16,96	-24.831	-24.098	3,04
7.3.2 Comisión administrador	-43.455	-32.617	33,23	0	0	-	-32.542	-29.828	9,10	-75.997	-62.445	21,70
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	-3.097	-2.915	6,24	0	0	-	-889	-807	10,16	-3.986	-3.722	7,09
7.3.4 Comisión variable	-986.589	-1.310.290	-24,70	0	0	-	-70.009	-35.808	95,51	-1.056.598	-1.346.098	-21,51
7.3.5 Otras comisiones del cedente	-11	0	-	0	0	-	0	0	-	-11	0	-
7.3.6 Otros gastos	-10.837	-8.840	22,59	0	0	-	-35.376	-2.644	-	-46.213	-11.484	302,41
8. Deterioro de activos financieros (neto)	-246.684	-127.747	-93,10	0	0	-	22.828	-209.984	-	-223.856	-337.731	33,72
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	-246.739	-127.941	-92,85	0	0	-	22.828	-209.984	-	-223.911	-337.925	33,74
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	55	194	-71,65	0	0	-	0	0	-	55	194	-71,65
9. Dotaciones a provisiones (neto)	-48.363	-83.618	42,16	0	0	-	-35.940	-40.095	10,36	-84.303	-123.713	31,86
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0	0	-	0	0	-	0	0	-	0	0	-
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	-48.674	-83.414	41,65	0	0	-	-35.940	-40.095	10,36	-84.614	-123.509	31,49
9.3 Dotación otras provisiones	311	-204	-	0	0	-	0	0	-	311	-204	-
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	-757	68.666	-	0	0	-	-88	0	-	-845	68.666	-
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	350.322	45.754	665,66	0	0	-	285.562	434.938	-34,34	635.884	480.692	32,29
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0	0	-	0	0	-	0	0	-	0	0	-
12. Impuesto sobre beneficios	0	0	-	0	0	-	0	0	-	0	0	-
C) RESULTADO DEL PERIODO	0	0	-	0	0	-	0	0	-	0	0	-

	BONOS/ F. PÚBLICOS			PAGARÉS/ F. PÚBLICOS			F. PRIVADOS			TOTAL		
	2023	2022	%	2023	2022	%	2023	2022	%	2023	2022	%
Miles de euros												
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	355.564	74.480	377,40	0	0	-	-187.861	-309.744	-39,35	167.703	-235.264	-
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	1.371.870	1.523.085	-9,93	0	0	-	-116.262	-281.577	58,71	1.255.608	1.241.508	1,14
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	4.914.203	2.949.698	66,60	0	0	-	350.862	96.957	261,87	5.265.065	3.046.655	72,81
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	-4.164.879	-1.248.336	233,63	0	0	-	-465.928	-372.852	24,96	-4.630.807	-1.621.188	185,64
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	1.457.608	187.702	676,55	0	0	-	17.620	622	-	1.475.228	188.324	683,35
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	-824.525	-270.239	205,11	0	0	-	-15.666	-20	-	-840.191	-270.259	210,88
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	106.638	2.252	-	0	0	-	9.097	1.449	527,81	115.735	3.701	-
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	-200.635	-101.872	96,95	0	0	-	-13.435	-7.846	71,23	-214.070	-109.718	95,11
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	83.458	3.881	-	0	0	-	1.188	113	951,33	84.646	3.994	-
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	-1.016.911	-1.433.054	-29,04	0	0	-	-99.560	-64.196	55,09	-1.116.471	-1.497.250	-25,43
2.1 Comisión sociedad gestora	-18.482	-18.907	-2,25	0	0	-	-5.838	-5.248	11,24	-24.320	-24.155	0,68
2.2 Comisión administrador	-41.767	-31.681	31,84	0	0	-	-31.213	-31.158	0,18	-72.980	-62.839	16,14
2.3 Comisión agente financiero/pagos	-3.091	-2.899	6,62	0	0	-	-1.079	-1.132	-4,68	-4.170	-4.031	3,45
2.4 Comisión variable	-950.088	-1.375.459	-30,93	0	0	-	-56.121	-25.208	122,63	-1.006.209	-1.400.667	-28,16
2.5 Otras comisiones	-3.483	-4.108	-15,21	0	0	-	-5.309	-1.450	266,14	-8.792	-5.558	58,19
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	605	-15.551	-	0	0	-	27.961	36.028	-22,39	28.566	20.477	39,50
3.1 Pagos por garantías financieras	-2.407	-1.560	54,29	0	0	-	-5.461	-3.769	44,89	-7.868	-5.329	47,64
3.2 Cobros por garantías financieras	1.841	3.124	-41,07	0	0	-	62.357	40.798	52,84	64.198	43.922	46,16
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	-2.323	-2.249	3,29	0	0	-	0	0	-	-2.323	-2.249	3,29
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	2.084	3.588	-41,92	0	0	-	0	0	-	2.084	3.588	-41,92
3.5 Otros pagos de explotación	-2.462.519	-2.324.434	5,94	0	0	-	-242.544	-45.627	431,58	-2.705.063	-2.370.061	14,13
3.6 Otros cobros de explotación	2.463.929	2.305.980	6,85	0	0	-	213.608	44.626	378,66	2.677.537	2.350.606	13,91
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	-244.153	682.815	-	0	0	-	83.174	-589.482	-	-160.979	93.333	-
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	14.665.500	20.647.313	-28,97	0	0	-	2.155.260	2.690.314	-19,89	16.820.760	23.337.627	-27,92
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	-20.049.059	-25.472.055	-21,29	0	0	-	-2.561.365	-3.684.400	-30,48	-22.610.424	-29.156.455	-22,45
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	3.385.900	5.557.426	-39,07	0	0	-	977.721	410.927	137,93	4.363.621	5.968.353	-26,89
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	15.156.355	15.511.467	-2,29	0	0	-	2.366.013	2.659.560	-11,04	17.522.368	18.171.027	-3,57
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	10.861.479	8.578.324	26,62	0	0	-	309.630	496.371	-37,62	11.171.109	9.074.695	23,10
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	552.416	527.758	4,67	0	0	-	359.873	282.658	27,32	912.289	810.416	12,57
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	64.670	147.878	-56,27	0	0	-	417	819	-49,08	65.087	148.697	-56,23
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	76.293	197.203	-61,31	0	0	-	0	0	-	76.293	197.203	-61,31
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	-23.325.312	-19.405.204	20,20	0	0	-	-2.058.212	-3.028.482	-32,04	-25.383.524	-22.433.686	13,15
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	1.753.506	-49.870	-	0	0	-	-488.443	-6.323	-	1.265.063	-56.193	-
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	3.964.057	2.358.067	68,11	0	0	-	226.441	4.039	-	4.190.498	2.362.106	77,41
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	-2.093.124	-2.409.820	-13,14	0	0	-	-75.611	-3.180	-	-2.168.735	-2.413.000	-10,12
7.3 Pagos a Administraciones públicas	-480	-73	557,53	0	0	-	-594	-626	-5,11	-1.074	-699	53,65
7.4 Otros cobros y pagos	-116.947	1.957	-	0	0	-	-638.681	-6.555	-	-755.628	-4.598	-
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	111.410	757.295	-85,29	0	0	-	-104.687	-899.225	88,36	6.723	-141.930	-
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8.833.446	8.076.152	9,38	0	0	-	1.125.038	2.024.263	-44,42	9.958.484	10.100.415	-1,41
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8.944.857	8.833.446	1,26	0	0	-	1.020.351	1.125.038	-9,31	9.965.208	9.958.484	0,07

PERIODO	DERECHOS DE CRÉDITO - PRINCIPALES RATIOS						VALORES EMTIDOS - MEJORAS			
	TA (1)	TAA (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	% ACTIVOS NO CORRIENTES EN VENTA (6)	% PÉRDIDAS REPERCUTIDAS (7)	% AVAL (8)	% FR (9)	% LÍNEA DE LIQUIDEZ (10)
Fondos de titulización públicos - bonos										
dic-23	140.629.446	7,78	1,74	1,44	3,85	0,26	-1,78	3,88	4,33	0,48
dic-22	152.083.350	5,93	1,54	1,49	6,22	0,27	-1,48	6,07	4,09	1,66
dic-21	168.944.581	4,15	1,71	1,31	2,72	0,31	-1,29	6,41	4,09	1,26
dic-20	188.864.783	3,45	1,91	1,20	1,18	0,35	-1,12	7,51	4,10	1,55
dic-19	186.061.492	3,63	1,90	1,12	3,37	0,37	-1,14	8,32	4,18	1,61
dic-18	198.923.354	3,23	1,91	0,96	1,43	0,38	-1,19	8,93	4,16	1,59
sept-18	206.423.317	3,11	1,94	0,92	1,38	0,36	-1,24	8,17	4,08	0,82
jun-18	211.095.203	3,21	1,88	0,89	0,62	0,40	-1,25	9,09	3,96	1,39
mar-18	217.679.794	2,95	1,94	0,84	0,77	0,40	-1,20	8,75	3,90	1,36
dic-17	219.988.347	3,13	2,02	0,84	0,70	0,41	-1,17	8,87	3,81	1,45
Fondos de titulización públicos - bonos - sin titulización de cédulas										
dic-23	128.436.126	8,58	1,92	1,59	4,24	0,28	-1,95	4,28	4,77	0,29
dic-22	138.217.952	6,58	1,70	1,65	6,90	0,30	-1,63	6,72	4,53	1,58
dic-21	151.067.429	4,67	1,93	1,48	3,07	0,35	-1,44	7,22	4,60	1,09
dic-20	165.650.046	3,97	2,20	1,38	1,35	0,40	-1,27	8,62	4,71	1,36
dic-19	159.473.350	4,28	2,24	1,32	3,97	0,43	-1,33	9,79	4,92	1,40
dic-18	169.167.094	3,84	2,27	1,14	1,70	0,44	-1,40	10,59	4,91	1,33
sept-18	173.237.685	3,74	2,33	1,10	1,66	0,43	-1,48	9,83	4,85	0,49
jun-18	178.094.915	3,84	2,25	1,07	0,74	0,48	-1,48	10,86	4,68	1,28
mar-18	182.079.626	3,57	2,34	1,02	0,93	0,47	-1,43	10,55	4,69	1,27
dic-17	183.302.370	3,79	2,45	1,02	0,85	0,49	-1,40	10,74	4,59	1,28
Fondos de titulización públicos - pagarés										
dic-23	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
dic-22	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
dic-21	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
dic-20	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
dic-19	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
dic-18	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sept-18	469.365	-	8,20	-	-	0,14	-0,03	-	7,58	100,00
jun-18	654.862	-	0,04	-	-	0,12	-	-	10,09	100,00
mar-18	999.091	-	0,04	0,61	-25,79	0,08	-0,31	-	20,88	100,00
dic-17	1.209.449	-	0,13	1,91	15,55	0,06	-0,24	-	9,08	100,00
Fondos de titulización privados										
dic-23	6.719.981	4,00	12,24	0,11	0,02	-	-43,91	-	0,86	2,16
dic-22	6.799.361	6,90	16,14	0,10	0,05	-	-39,24	-	2,03	2,63
dic-21	7.036.757	12,92	12,37	0,10	0,02	-	-31,76	-	1,86	-
dic-20	4.318.726	0,87	35,80	0,02	-	-	-48,09	-	-	8,07
dic-19	4.497.792	0,23	23,66	-	-	-	-39,41	-	0,01	7,52
dic-18	3.890.410	-	2,25	-	-	-	-38,93	-	0,01	9,16
sept-18	3.982.391	0,01	2,41	-	-	-	-32,06	-	-	9,63
jun-18	3.846.211	0,04	2,68	-	-	-	-31,42	-	-	9,86
mar-18	3.898.749	0,03	2,70	-	-	-	-28,28	-	-	9,96
dic-17 **	4.195.682	0,03	1,94	-	-	-	-22,96	-	-	9,36

* Datos trimestrales en el período 2017-2018. A partir de 2019 los datos son anuales.

** Se han excluido los datos del fondo de titulización IM Auriga Pymes Eur 1 por considerarse atípicos.

Información sobre los encabezados:

(1) Total activo. 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

(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

(6) Porcentaje que representa el valor en libros de los activos no corrientes mantenidos para la 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 pasivos emitidos

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

	PERIODO	IMPORTE PENDIENTE (1)	TAA (2)	% DEUDA / VT (3)	DUDOSOS (4)	FALLIDOS (5)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (6)	VIDA RESIDUAL (7)	ANTIGÜEDAD (8)	INTERESES (9)	TASA CONCENTRACIÓN	
											POR DEUDOR (10)	GEOGRÁFICA /SECTORIAL
FONDOS PÚBLICOS												
Hipotecarios	31/12/2023	80.485.401	9,69	55,08	2,10	1,82	5,52	19,57	11,62	3,57	0,55	30,47
	31/12/2022	89.884.749	6,60	57,12	1,68	1,65	7,74	20,07	11,07	1,16	0,53	30,54
Cédulas hipotecarias, territoriales y de internacionalización	31/12/2023	11.973.008	0,00	-	-	-	-	3,37	16,25	4,14	-	24,93
	31/12/2022	13.586.799	0,00	-	-	-	-	4,15	16,98	4,08	-	24,18
Préstamos a promotores	31/12/2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Préstamos a empresas, corporativos y PYMES	31/12/2023	7.166.742	4,28	21,08	1,87	1,86	2,88	6,00	4,46	4,12	7,22	15,55
	31/12/2022	6.371.702	4,15	36,96	2,44	1,94	10,78	5,84	5,30	2,40	7,40	14,09
Deuda subordinada y bonos de tesorería	31/12/2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAPP	31/12/2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Consumo y automoción	31/12/2023	19.267.523	9,50	0,00	2,07	1,28	1,27	3,94	3,00	7,07	0,13	23,21
	31/12/2022	16.219.893	10,56	0,00	2,07	1,07	4,02	3,74	3,04	7,29	0,17	22,27
Cuentas a cobrar y cuotas de leasing	31/12/2023	2.575.031	0,77	3,56	0,22	0,32	1,28	4,71	3,38	5,25	9,95	22,52
	31/12/2022	404.845	6,85	39,02	1,62	1,81	18,35	4,99	7,28	2,49	24,02	21,55
Derechos de crédito futuros	31/12/2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Bonos de titulación	31/12/2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Otros	31/12/2023	6.564.335	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,52	11,29	2,01	100,00	-
	31/12/2022	8.427.567	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,46	10,36	1,87	100,00	-
Pagarés	31/12/2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FONDOS PRIVADOS	31/12/2023	4.737.015	4,00	18,64	12,24	0,11	0,02	5,89	5,55	3,12	36,32	-
	31/12/2022	5.023.599	7,21	17,03	16,28	0,09	0,18	6,32	6,20	1,89	50,41	-

Información sobre los encabezados

- (1) Miles de euros.
- (2) Tasa de amortización anticipada.
- (3) Porcentaje que representa la deuda total sobre el valor de tasación de la garantía.
- (4) Tasa de dudosos: cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos y el principal pendiente del total activos.
- (5) 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.
- (6) 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.
- (7) Vida residual media ponderada valorada en años.
- (8) Antigüedad media ponderada valorada en años.
- (9) Tipo de interés medio ponderado.
- (10) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración.

PERIODO	HIPOTECARIOS	CEDULAS HIPOTECARIAS, TERRITORIALES Y DE INTERNACIONALIZACIÓN	PRÉSTAMOS A PROMOTORES	PRÉSTAMOS A EMPRESAS, CORPORATIVOS Y PYMES	DEUDA SUBORDINADA Y BONOS DE TESORERÍA	AAPP	CONSUMO Y AUTOMOCIÓN	CUENTAS A COBRAR Y CUOTAS DE LEASING	DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS	BONOS DE TITULIZACIÓN	OTROS	PAGARÉS	FONDOS PRIVADOS	TOTAL
dic-23	124	4	0	16	0	0	33	3	0	0	1	0	55	236
dic-22	130	4	0	18	0	0	34	3	0	0	1	0	53	243
dic-21	144	6	0	19	0	0	28	3	0	0	1	0	40	241
dic-20	162	7	0	22	0	0	26	3	0	0	1	0	33	255
dic-19	170	10	0	22	0	0	23	2	0	0	1	0	25	256
dic-18	177	11	0	32	0	0	24	2	0	0	2	0	19	268
sep-18	183	12	0	33	0	0	25	3	0	0	2	1	18	278
jun-18	183	12	0	34	1	0	24	3	0	0	2	1	19	280
mar-18	193	12	0	35	1	0	24	3	0	0	2	1	18	289
dic-17	193	12	0	34	0	0	23	3	0	0	2	1	18	287

* Datos trimestrales en el período 2017-2018. A partir de 2019 los datos son anuales.

FONDO	TIPO	GESTORA	CEDEnte	TOTAL ACTIVO (1)	
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	MULTICEDENTE	175.238
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO MARE NOSTRUM	51.564
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	AHORRO CORPORACIÓN FINANCIERA	1.635.421
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	AHORRO CORPORACIÓN FINANCIERA	2.081.709
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	MULTICEDENTE	1.029.812
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	1.134.637
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	386.421
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	421.351
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	KUTXABANK	155.985
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	KUTXABANK	177.765
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	MULTICEDENTE	210
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	MULTICEDENTE	78.246
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	KUTXABANK	43.248
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	KUTXABANK	127.987
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	KUTXABANK	270.795
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO POPULAR ESPAÑOL	5.158
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO POPULAR ESPAÑOL	110.112
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	ABANCA CORPORACION BANCARIA	531.377
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	ABANCA CORPORACION BANCARIA	559.427
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	619.132
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	284.860
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	628.466
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	732.636
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	951.060
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	7.741.541
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	1.648.787
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	1.401.274
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	116.508
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	86.070
BANCAJA 10, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	533.795
BANCAJA 11, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	498.212
BANCAJA 13, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	1.168.559
BANCAJA 8, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	164.628
BANCAJA 9, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	277.634
BANKINTER 10, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANKINTER	174.721
BANKINTER 13 FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANKINTER	263.997
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	129.289
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	604.396
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	837.457
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	562.592
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	924.753
BBVA LEASING 1, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	2.699
BBVA RMBS 1, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	556.671
BBVA RMBS 14, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	309.439
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	975.602
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.446.748
BBVA RMBS 2, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.033.039
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	2.267.835
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	11.034.843
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.571.110
BBVA RMBS 3, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	949.160
BBVA RMBS 5 FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.699.512
BBVA RMBS 9, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	598.568
BBVA-6 FTPYME FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	2.696
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	RCI BANQUE SA	1.254.456
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO SANTANDER	8.511
HIPOCAT 10, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	150.191
HIPOCAT 11, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	168.573
HIPOCAT 9, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	110.134
MBS BANCAJA 3, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	82.263
MBS BANCAJA 4, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	254.806
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	230.597
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	131.666
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	337.798

FONDO		TIPO		GESTORA	CEDENTE	TOTAL ACTIVO (1)
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	447.775
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	246.422
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAJA RURAL DE ARAGON, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	78.469
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	216.559
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	53.313
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	43.815
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAJA RURAL DE ARAGON, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	153.020
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	107.698
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	458.354
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	110.474
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO CETELEM	239.563
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO CETELEM	588.344
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO CETELEM	502.434
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	SERVICIOS FINANCIEROS CARREFOUR	672.120
IM ANDBANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	ANDBANK	105.692
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	360.249
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	484.215
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	442.042
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	571.259
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	187.350
IM BCG RMBS 2, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO CAIXA GERAL	624.742
IM CAJAMAR 3, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	146.222
IM CAJAMAR 4, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	151.965
IM CAJAMAR 5, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	155.495
IM CAJAMAR 6, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	404.235
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	230.698
IM PASTOR 4, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO PASTOR	119.775
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	4.665
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	300.241
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	570.841
FTA UCI 11	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	94.921
FTA UCI 14	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	228.873
FTA UCI 16	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	387.832
FTA, UCI 15	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	283.351
FTA, UCI 17	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	338.448
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	1.177.534
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNIÓN DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, E.F.C.	398.500
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO X	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	497.134
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER, EFC	191.825
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER	421.440
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	424.494
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	3.353.916
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	4.388.495
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER	230.338
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER	171.864
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER, EFC	738.536
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER	650.145
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	FCA CAPITAL ESPAÑA E.F.C., S.A.U.	119.757
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	PSA FINANCIAL SERVICES SPAIN, E.F.C., S.A.	44.713

FONDO	TIPO	GESTORA	CEDEnte	TOTAL ACTIVO (1)
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. PSA FINANCIAL SERVICES SPAIN, E.F.C., S.A.	178.205
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. PSA FINANCIAL SERVICES SPAIN, E.F.C., S.A.	475.611
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. CAIXABANK, BANCO SABADELL	112.405
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. CAIXABANK, BANCO SABADELL	76.291
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. CAIXABANK, BANCO SABADELL	27.111
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. CAJA DE INGENIEROS	81.722
CEDULAS TDA 6, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. MULTICEDENTE	3.077.089
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. MULTICEDENTE	7.063.696
FTPyme TDA CAM 4, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. BANCO SABADELL	76.693
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. CAIXABANK	287.465
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. CAIXABANK	277.123
MADRID RMBS I, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. CAIXABANK	440.899
MADRID RMBS II, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. CAIXABANK	387.367
MADRID RMBS III, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. CAIXABANK	821.317
MADRID RMBS IV, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. CAIXABANK	667.997
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. CETELEM	871.352
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. VOLKSWAGEN BANK	1.383.129
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. MULTICEDENTE	5.399.101
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. ING DIRECT	17.132.093
TDA 19 - MIXTO, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. MULTICEDENTE	41.098
TDA 22 - MIXTO, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. MULTICEDENTE	50.689
TDA 24, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. MULTICEDENTE	56.755
TDA 25, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. MULTICEDENTE	49.459
TDA 26 - MIXTO, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. MULTICEDENTE	85.100
TDA 27, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. MULTICEDENTE	160.614
TDA 28, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. MULTICEDENTE	131.566
TDA 29, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. MULTICEDENTE	139.548
TDA 30, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. BANCA MARCH	97.212
TDA CAJAMAR 2, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. CAJAMAR	88.887
TDA CAM 4, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. BANCO SABADELL	108.005
TDA CAM 5, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. BANCO SABADELL	266.419
TDA CAM 6, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. BANCO SABADELL	197.410
TDA CAM 7, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. BANCO SABADELL	301.846
TDA CAM 8, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. BANCO SABADELL	270.961
TDA CAM 9, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. BANCO SABADELL	292.398
TDA IBERCAJA 3, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. IBERCAJA	122.445
TDA IBERCAJA 4, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. IBERCAJA	192.715
TDA IBERCAJA 5, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. IBERCAJA	204.216
TDA IBERCAJA 6, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. IBERCAJA	349.695
TDA IBERCAJA 7, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. IBERCAJA	677.073
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. BANCO SABADELL	3.674.289
TDA TARRAGONA 1, FTA	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	64.203
Subtotal FTA/BONOS constituidos en periodos anteriores				123.883.178
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T. S.A. BANCO CETELEM	591.700
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	740.053
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	2.644.495
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A. CAIXABANK	3.177.212
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A. CAIXABANK	2.106.941
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T. BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	2.532.672
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. UNIÓN DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, E.F.C.	462.422
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T. S.A. RIBEIRA HOLDINGS, S.À R.L.	201.057
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FT	674.095
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. BANCO SANTANDER	711.941
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A. SANTANDER CONSUMER E.F.C.	610.484
Subtotal FTA/BONOS constituidos en el periodo				14.453.072
Total FTA/BONOS				138.336.250
Subtotal FTA/PAGARÉS constituidos en periodos anteriores				0
Subtotal FTA/PAGARÉS constituidos en el periodo				0
Total FTA/PAGARÉS				0

FONDO	TIPO	GESTORA		CEDEnte	TOTAL ACTIVO (1)	
Total FTA - PÚBLICOS					138.336.250	
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	156.089
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	66.250
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	152.692
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	220.757
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	171.421
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	225.331
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	178.424
BANKINTER 11, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANKINTER	111.672
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	26.885
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	FTH	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	294.582
IM PASTOR 2, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO PASTOR	40.182
IM PASTOR 3, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO PASTOR	92.337
FTH UCI 12	FTH	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	128.930
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	FTH	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	366.222
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	IBERCAJA	61.422
Subtotal FTH constituidos en periodos anteriores					2.293.196	
Subtotal FTH constituidos en el periodo					0	
Total FTH - PÚBLICOS					2.293.196	
Total FONDOS PUBLICOS					140.629.446	
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO PASTOR	20.391
FTA2015, FTA	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CATALUNYA BANC	378.251
SLF, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	FIRE HOLDCO S.À R.L.	82.300
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	PATRIOT HOLDCO S.À R.L.	58.968
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	NEPTUNE LUX HOLDCO, S.À R.	453.842
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	TRADE & WORKING CAPITAL, S.A.U.	99.106
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	260.512
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	CREALSA INVESTMENTS SPAIN, S.A.	11.780
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	CREALSA INVESTMENTS SPAIN, S.A.	11.997
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	ZEPÀ FINANCE, S.L.	532
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	MULTICEDENTE	23.971
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	NPL CESION S.L.	10.532
PENSIUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	PENSIUM DIRECT, S.L.	2.195
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	NEXTGEN FINANCIAR SERVICES S.L.	17.407
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	AQUISGRAN FINANCE, S.A.	153.825
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CRISAE PRIVATE DEBT S.L.	31.260
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	GEDESCO INNOVFIN S.L.	23.956
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCA MARCH	375.109
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCA MARCH	23.634
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO SABADELL	100.448
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	PERFECTA	18.092
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	SACYR INDUSTRIAL OPERACION Y MANTENIMIENTO, S.L	184.759
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	43.353
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	250.630
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	7.930
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	23.849
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	63.279
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	54.250
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	96.618
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	14.078
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	ELLINGTON RESIDENTIAL HOLDINGS	561.737
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	115.426
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	ELECNOR, S.A.	55.906
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	SÜD-WEST-KREDITBANK FINANZIERUNG GMBH	407.210
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	65.689
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	DEUTSCHE BANK AG LONDON BRANCH	12.572
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	FNPL ESP INVESTMENTS DESIGNATED ACTIVITY COMPANY	97.056

FONDO		TIPO		GESTORA	CEDENTE	TOTAL ACTIVO (1)
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BTL IV	155.411
Subtotal FTA/PRIVADOS/BONOS constituidos en periodos anteriores						4.367.861
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	MULTICEDENTE	205
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	FUTBOL CLUB BARCELONA	1.146.031
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	LC ASSET 2, S.Á.R.L.	40.971
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	UNIÓN FINANCIERA ASTURIANA, E.F.C., S.A.U.	142.195
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	49.817
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	164.419
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	FNPL ESP INVESTMENTS DESIGNATED ACTIVITY COMPANY	29.174
Subtotal FTA/PRIVADOS/BONOS constituidos en el periodo						1.572.812
Total FTA/PRIVADOS/BONOS						5.940.673
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	MULTICEDENTE	11.987
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	TRADE & WORKING CAPITAL, S.A.U.	35.884
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	ZEPA FINANCE, S.L.	21.464
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	ALTAMAR PRIVATE EQUITY S.G.I.I.C., S.A.U.	67.515
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	FORTIA	101.147
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	SUMMA ENERGY SERVICIOS FINANCIEROS	29.341
Subtotal FTA/PRIVADOS/PAGARÉS constituidos en periodos anteriores						267.338
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	SUMMA FAF, S.L.U.	136.572
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FT	14.565
Subtotal FTA/PRIVADOS/PAGARÉS constituidos en el periodo						151.137
Total FTA/PRIVADOS/PAGARÉS						418.475
Total FTA - PRIVADOS						6.359.148
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	FTH	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	85.323
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	FTH	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	LSFLL VERDE FINANCE S.A. R. L.	275.510
Subtotal FTH/PRIVADOS constituidos en periodos anteriores						360.833
Subtotal FTH/PRIVADOS constituidos en el periodo						0
Total FTH - PRIVADOS						360.833
Total FONDOS PRIVADOS						6.719.981

(1) Miles de euros.

Principales magnitudes de balance

CUADRO A.1

Miles de euros

FONDO	ACTIVO		PASIVO			DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO)
	ACTIVOS TITULIZADOS	ACTIVOS NO CORRIENTES MANTENIDOS PARA LA VENTA	OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS	DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO	CORRECCIÓN DE VALOR POR REPERCUSIÓN DE PÉRDIDAS	
BONOS						
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	107.276	0	114.776	0	0	0
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	38.296	0	41.491	2.636	0	0
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	159.354	0	169.309	10	0	3.247
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	442.054	0	458.352	17	0	9.618
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	214.707	0	219.653	4.650	-4.077	7.751
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	533.366	0	553.777	5.790	0	24.941
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	475.895	0	484.497	7.029	0	4.654
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	570.938	0	575.332	8.836	0	-10.479
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	144.660	0	148.768	24.035	-2.707	0
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	48.006	152	49.370	26	-13.106	-523
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	1.589.763	0	1.589.313	45.699	-9	0
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	2.038.357	0	2.037.910	41.851	-15	0
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	886.541	0	918.447	108.008	-65.672	-1.502
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	142.609	95	150.142	5.842	-1.103	-859
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	57.527	0	61.140	5.034	-787	20
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	140.958	0	143.715	8.607	-903	33
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	202.397	802	210.910	9.447	-1.697	106
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	162.019	644	164.928	6.346	-5.353	-1.011
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	199.035	284	206.479	18.717	-16.068	-3.405
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	147.408	803	149.425	28.871	-5.356	-2.986
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	1.017.083	1.610	1.027.175	106.601	-1.023	-24.715
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	323.974	868	348.562	37.695	-1.643	-8.399
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	353.223	97	381.491	39.664	-4.349	-9.151
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	123.844	0	130.671	24.299	0	28
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	156.688	0	164.884	10.926	0	-349
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	0	0	187	1	-9.509	0
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	69.547	56	71.790	4.691	-788	-180
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	37.488	0	39.023	4.125	-398	-280
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	114.921	0	120.162	6.810	0	-960
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	241.084	0	253.677	13.562	-382	-6.517
BANCAJA 10, FTA	503.456	10.678	533.309	0	-34.974	-5.021
BANCAJA 11, FTA	473.898	7.958	498.093	0	-35.684	-5.207
BANCAJA 13, FTA	986.499	14.282	1.003.063	164.229	-78.347	-4.936
BANCAJA 8, FTA	140.552	2.495	154.524	0	-4.027	-571
BANCAJA 9, FTA	248.980	4.604	275.867	1.473	-21.767	-2.427
BANKINTER 10, FTA	157.982	0	169.707	0	-2.523	-1.591
BANKINTER 11, FTH	100.452	0	109.010	0	-2.372	-919
BANKINTER 13 FTA	232.621	421	252.964	457	-2.783	-2.077
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	109.488	0	127.084	0	0	0
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	505.965	0	571.238	0	0	28.165
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACION	759.931	0	808.863	0	0	22.396
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	719.424	0	734.798	0	0	-19.013
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	531.444	0	561.087	0	0	0
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	806.763	0	832.824	83.323	0	0
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	2.349.872	0	2.474.727	150.163	0	0
BBVA LEASING 1, FTA	1.854	37	2.669	0	-95.286	-2.229
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	2.316.552	0	2.403.812	120.807	0	-6.340
BBVA RMBS 1, FTA	522.863	2.050	517.486	35.209	-13.030	-2.521
BBVA RMBS 14, FTA	278.048	0	279.944	29.482	-3.928	0
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	868.704	0	681.392	289.038	0	0
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	1.304.288	0	1.135.841	301.436	0	-33.797
BBVA RMBS 2, FTA	982.040	6.400	971.688	27.575	-5.905	-6.430
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	1.929.180	0	1.972.237	125.789	0	169.717
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	9.978.330	0	10.250.539	623.331	0	128.076
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	1.281.556	0	1.313.305	71.041	0	189.440
BBVA RMBS 3, FTA	917.826	5.482	946.661	0	-173.541	-2.204
BBVA RMBS 5 FTA	1.524.321	2.033	1.527.959	171.524	-249.466	0
BBVA RMBS 9, FTA	536.992	47	400.555	194.279	-706	0
BBVA-6 FTPYME FTA	1.252	585	2.682	0	-43.815	-700
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	98.243	83	100.538	7.471	0	35
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	31.491	142	29.728	43.257	0	18
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	19.168	511	14.563	6.954	0	4

Miles de euros

FONDO	ACTIVO		PASIVO			DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO)
	ACTIVOS TITULIZADOS	ACTIVOS NO CORRIENTES MANTENIDOS PARA LA VENTA	OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS	DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO	CORRECCIÓN DE VALOR POR REPERCUSIÓN DE PÉRDIDAS	
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	464.695	0	580.159	35.140	0	0
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	1.943.085	0	2.002.579	100.817	0	0
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	256.625	0	269.112	14.605	0	0
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	542.802	0	601.812	26.603	-4.849	0
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	623.045	0	691.288	36.922	0	0
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	866.086	0	899.847	49.732	0	0
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACION	2.927.676	0	3.009.496	162.557	0	0
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	7.062.293	0	7.221.554	519.957	-106.070	0
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	1.492.343	0	1.556.996	91.715	-22.055	0
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	1.323.690	0	1.346.425	54.827	-14.381	0
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	63.812	0	67.022	14.687	-1.738	0
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	1.188.380	0	1.227.957	14.010	0	0
CEDULAS TDA 6, FTA	3.070.512	0	3.070.512	0	0	0
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	604.240	0	566.257	104.668	0	0
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	3.295	45	1.026	7.336	-15.036	58
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	82.644	0	114.768	1.800	-15.054	-1.102
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	63.732	0	83.563	2.282	-10.581	29
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	3.643	169	4.382	0	-51.269	289
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	261.846	3.464	296.202	0	-12.598	4.788
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	524.292	10.789	562.466	0	-155.518	8.799
FTA UCI 11	81.778	0	78.754	12.779	-1.019	0
FTA UCI 14	216.244	133	200.742	11.621	0	0
FTA UCI 16	371.164	387	361.612	0	-987	0
FTA, UCI 15	271.126	160	267.974	0	0	0
FTA, UCI 17	326.110	349	320.277	0	-28	-2.155
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	6.564.336	0	4.838.179	1.686.025	0	0
FTH UCI 12	118.201	65	114.738	10.372	-1.085	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	872.350	46	1.177.396	0	-21.895	0
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	349.943	0	352.580	5.629	-1.716	39.801
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	355.934	0	358.371	3.774	-3.741	1.472
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO X	467.930	0	471.084	6.864	-3.107	17.607
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2	165.516	0	186.568	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	387.803	0	393.318	0	-869	17.115
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	397.283	0	399.031	3.642	-4.735	17.772
FTPYME TDA CAM 4, FTA	44.473	4.566	76.805	0	-16.007	-2
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	15.291	0	22.337	0	-4.316	191
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	2.562	2.264	4.969	151	-27.246	16
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	99.490	8.907	110.033	0	-41.265	-3.017
HIPOCAT 10, FTA	139.385	2.212	149.360	0	-69.051	688
HIPOCAT 11, FTA	156.855	3.626	168.642	0	-129.796	-686
HIPOCAT 9, FTA	94.236	1.154	109.675	0	-12.261	198
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	460.916	0	328.584	202.730	-8.778	0
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	491.311	0	398.512	160.845	-7.087	0
IM ANDBANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	95.044	0	105.683	2	-667	0
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	329.813	0	335.557	0	0	0
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	458.514	0	466.564	2	0	0
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACION	396.657	0	408.624	4.680	0	0
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	527.053	0	541.009	3.774	0	0
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	162.457	0	172.055	452	0	0
IM BCG RMBS 2, FTA	566.688	0	450.250	133.093	0	0
IM CAJAMAR 3, FTA	131.821	0	133.196	0	0	-157
IM CAJAMAR 4, FTA	141.246	0	148.054	0	0	-766
IM CAJAMAR 5, FTA	144.811	0	153.651	0	-951	0
IM CAJAMAR 6, FTA	371.036	0	398.442	0	-3.148	0
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	179.632	0	176.784	49.606	-1.862	-482
IM PASTOR 2, FTH	33.274	550	31.552	5.002	-291	604
IM PASTOR 3, FTH	74.559	12.190	87.919	4.357	-55.069	-1.661
IM PASTOR 4, FTA	102.609	15.787	114.772	4.663	-14.286	-4.900
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	247.698	6.503	120.326	166.403	-12.247	-1.114
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	239.868	3.543	122.264	153.807	0	-343
MADRID RMBS I, FTA	383.807	15.817	374.005	53.968	-45.882	-6.003
MADRID RMBS II, FTA	337.514	13.573	324.297	45.890	-55.561	-1.984

Miles de euros

FONDO	ACTIVO		PASIVO			DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO)
	ACTIVOS TITULIZADOS	ACTIVOS NO CORRIENTES MANTENIDOS PARA LA VENTA	OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS	DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO	CORRECCIÓN DE VALOR POR REPERCUSIÓN DE PÉRDIDAS	
MADRID RMBS III FTA	737.636	35.482	746.553	51.559	-135.537	-3.794
MADRID RMBS IV, FTA	536.542	25.704	539.951	125.625	-216.588	-2.940
MBS BANCAJA 3, FTA	70.341	1.169	74.621	0	-755	-580
MBS BANCAJA 4, FTA	215.780	5.368	225.595	0	-2.345	-1.411
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	831.323	0	850.329	7.143	0	0
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	1.310.424	0	1.248.505	1	-1.292	0
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	5.274.376	0	5.274.376	102.853	0	0
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACION	453.561	0	457.798	4.533	-4.115	0
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	189.527	39	198.266	2.774	-9.670	0
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	3.074.963	990	3.352.236	0	-21.837	0
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	4.087.490	1.028	4.388.284	0	-35.538	0
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	209.342	604	218.951	0	0	-2.331
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	115.198	218	125.103	0	0	-870
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	305.559	431	313.189	22.535	0	-3.310
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	401.838	300	404.221	41.636	0	-4.735
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	218.749	72	220.538	24.601	0	-2.505
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	63.550	0	65.484	11.885	-693	0
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	265.614	0	274.112	19.415	0	0
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	179.750	0	185.265	28.230	-1.204	0
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	41.953	0	44.615	8.122	-432	0
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	27.091	0	17.784	25.998	-1.498	0
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	137.715	0	140.436	11.813	0	0
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE TITULIZACION	590.585	0	668.762	0	0	-13.399
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	89.636	0	104.359	0	-500	3.313
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	428.923	0	441.341	0	-616	7.359
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	211.948	0	219.114	0	0	7.806
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	158.883	0	160.869	0	0	6.785
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	686.732	0	704.776	0	0	-8.268
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	593.154	0	608.854	1.418	-2.439	-21.221
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	598.642	0	605.888	0	0	29.562
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	685.139	0	704.692	0	-5.487	-11.946
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	15.555.528	0	15.781.274	124.409	0	1.163.421
TDA 19 - MIXTO, FTA	28.161	0	28.625	11.962	0	79
TDA 22 - MIXTO, FTA	42.465	4.380	41.814	5.839	0	-508
TDA 24, FTA	46.992	6.358	55.280	5	-16.326	-565
TDA 25, FTA	393	14.762	47.255	532	-65.770	0
TDA 26 - MIXTO, FTA	73.464	0	79.722	0	0	-6
TDA 27, FTA	143.347	13.892	151.174	9.330	-37.832	0
TDA 28, FTA	109.837	17.421	126.905	4.547	-84.761	0
TDA 29, FTA	130.778	0	132.895	0	0	-613
TDA 30, FTA	90.081	0	92.835	0	0	-356
TDA CAJAMAR 2, FTA	76.295	0	77.212	3.361	0	10
TDA CAM 4, FTA	83.474	2.214	75.569	20.011	0	-9
TDA CAM 5, FTA	233.230	10.355	223.095	11.100	0	-637
TDA CAM 6, FTA	169.496	11.848	157.242	11.171	0	-773
TDA CAM 7, FTA	268.690	13.237	250.405	10.989	0	-1.483
TDA CAM 8, FTA	240.671	12.191	231.833	4.713	0	-1.379
TDA CAM 9, FTA	255.059	15.734	264.247	7.478	0	-1.213
TDA IBERCAJA 3, FTA	114.569	0	121.519	0	0	-30
TDA IBERCAJA 4, FTA	177.305	0	190.639	0	0	-291
TDA IBERCAJA 5, FTA	190.565	0	202.309	0	0	-788
TDA IBERCAJA 6, FTA	319.290	0	326.092	18.602	0	-2.753
TDA IBERCAJA 7, FTA	609.645	0	670.150	0	0	-3.884
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	39.466	0	61.433	113	-4.465	-265
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	3.385.458	0	3.433.745	102.296	0	13.044
TDA TARRAGONA 1, FTA	51.326	0	57.539	0	0	37
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	102.763	1.813	104.681	0	-3	-1.301
Subtotal BONOS 31/12/2023	128.032.439	365.128	128.942.437	7.831.051	-2.506.904	1.643.257
Subtotal BONOS 31/12/2022	134.895.555	408.299	137.478.387	6.039.052	-2.154.275	1.872.685
%Variación	-5,09	-10,57	-6,21	29,67	16,37	-12,25

Principales magnitudes de balance

CUADRO A.1

Miles de euros

FONDO	ACTIVO		PASIVO			DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO)
	ACTIVOS TITULIZADOS	ACTIVOS NO CORRIENTES MANTENIDOS PARA LA VENTA	OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS	DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO	CORRECCIÓN DE VALOR POR REPERCUSIÓN DE PÉRDIDAS	
PAGARES						
Subtotal PAGARÉS 31/12/2023	0	0	0	0	0	0
Subtotal PAGARÉS 31/12/2022	0	0	0	0	0	0
%Variación	-	-	-	-	-	-
PRIVADOS						
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE TITULIZACION	0	0	50	0	-931	0
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	6.996	0	11.761	0	-95	0
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	119.597	0	129.036	251	-249	0
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	20.390	0	20.390	0	0	0
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACION	115.422	0	115.223	0	-8.453	0
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	157.594	0	213.852	42.216	0	0
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE TITULIZACION	94.892	0	135.173	0	0	0
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACION	38.720	0	36.003	0	0	-63
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACION	30.509	0	31.226	0	-299	0
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACION	6.300	0	11.604	0	-15	0
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	21.408	0	21.170	0	0	0
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	515	0	522	0	-541	0
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACION	54.102	0	26.453	0	0	0
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	393.159	0	921.142	224.384	-58.864	-74.547
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	0	0	180.332	0	-2.481	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	0	0	129.111	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	0	0	7.430	0	-179	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	0	0	21.093	0	-1.120	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	0	0	59.228	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	0	0	50.413	0	-252	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	0	0	87.421	0	-3.922	0
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	12.216	0	12.216	0	-6	0
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	360.412	0	384.137	0	-118.686	0
FTA2015, FTA	356.884	0	370.003	1.126	-2.696.076	0
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	38.874	0	40.064	0	0	0
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	9.897	0	10.893	0	0	0
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	25.996	0	33.968	0	0	0
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	23.514	0	21.739	0	0	0
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	67.451	0	67.472	21	0	0
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	83.989	0	99.584	569	0	0
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	22.294	0	23.779	0	-8.745	0
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	374.399	0	374.600	0	-256	0
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	23.536	0	23.562	0	-150	0
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	20.867	0	28.406	99	0	0
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE TITULIZACION	8.204	0	12.900	154	0	0
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	99.690	0	100.423	0	-33	0
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	8.479	0	10.384	0	-102	0
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	45.321	0	32.300	0	0	0
PENSIUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	2.130	0	2.161	0	-159	0
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	17.488	0	17.539	367	-1.526	-364
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	180.699	0	85.521	0	0	0
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	27.237	0	27.420	0	0	0
SLF, FONDO DE TITULIZACION	77.220	0	78.013	0	-14.250	0
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	58.169	0	58.871	0	-12.968	0
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	453.830	0	453.507	168	0	0
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	396.013	0	400.016	6.954	0	0
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	65.669	0	65.296	0	-2.375	0
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	85.323	0	85.312	0	-8.162	0
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	12.572	0	12.460	0	-403	0
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	92.269	0	96.699	0	-1.614	0
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	148.637	0	153.787	0	0	0
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	71.852	0	96.385	0	0	0
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE TITULIZACION	135.180	0	139.827	0	0	0
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	256.653	0	151.760	0	0	0
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	14.447	0	17.267	0	-8.031	0

Miles de euros

FONDO	ACTIVO		PASIVO			DERIVADOS (ACTIVO - PASIVO)
	ACTIVOS TITULIZADOS	ACTIVOS NO CORRIENTES MANTENIDOS PARA LA VENTA	OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS	DEUDAS CON ENTIDADES DE CRÉDITO	CORRECCIÓN DE VALOR POR REPERCUSIÓN DE PÉRDIDAS	
Subtotal PRIVADOS 31/12/2023	4.737.015	0	5.796.904	276.309	-2.950.943	-74.974
Subtotal PRIVADOS 31/12/2022	5.023.600	0	5.745.078	127.415	-2.666.746	2.673
%Variación	-5,70	-	0,90	116,86	10,66	-2.904,86
Total 31/12/2023	132.769.454	365.128	134.739.341	8.107.360	-5.457.847	1.568.283
Total 31/12/2022	139.919.155	408.299	143.223.465	6.166.467	-4.821.021	1.875.358
%Variación	-5,11	-10,57	-5,92	31,47	13,21	-16,37

Importe pendiente derechos de crédito

CUADRO A.1.1

Miles de euros

FONDO	HIPOTECARIOS	CEDULAS HIPOTECARIAS, TERRITORIALES Y DE INTERNACIONALIZACIÓN	PRÉSTAMOS A PROMOTORES	PRÉSTAMOS A EMPRESAS, CORPORATIVOS Y PYMES	DEUDA SUBORDINADA Y BONOS DE TESORERÍA	AAPP	CONSUMO Y AUTOMOCIÓN	CUENTAS A COBRAR Y CUOTAS DE LEASING	DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS	BONOS DE TITULIZACIÓN	OTROS	PAGARÉS	PRIVADOS	DUDOSOS - DETERIORO	INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES
BONOS															
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	6.655	-10
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	119.360	0
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	0	0	0	106.253	0	0	0	0	-	-	484	540
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	37.885	0	0	0	0	-	-	192	219
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	157.892	0	0	0	0	-	-	437	1.025
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	439.468	0	0	0	0	-	-	388	2.198
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	212.712	0	0	0	0	-	-	812	1.182
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	529.353	0	0	0	0	-	-	1.295	2.717
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	471.284	0	0	0	0	-	-	2.104	2.508
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	567.824	0	0	0	0	-	-	111	3.002
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	19.753	0
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	143.197	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.145	317
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	46.838	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.102	66
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	0	1.545.000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	44.763
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	0	2.000.000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	38.357
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	874.792	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	9.687	2.062
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	142.152	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	213	244
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	57.404	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	15	108
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	140.493	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	205	259
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	201.255	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	747	396
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	161.215	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	504	299
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	198.370	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	328	337
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	146.290	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	839	279
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	1.010.552	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.680	1.851
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	321.887	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.491	596
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	350.500	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.106	616
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	122.986	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	582	276
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	154.423	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.915	350
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	68.911	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	516	120
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	37.214	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	177	96
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	114.378	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	213	330
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	238.270	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.056	757
BANCAJA 10, FTA	466.359	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	35.621	1.476
BANCAJA 11, FTA	439.087	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	33.442	1.369
BANCAJA 13, FTA	954.235	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	29.200	3.064
BANCAJA 8, FTA	132.554	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	7.618	380
BANCAJA 9, FTA	226.880	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	21.395	705
BANKINTER 10, FTA	155.902	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.765	315
BANKINTER 11, FTH	98.533	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.727	192
BANKINTER 13 FTA	227.217	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.949	455
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE	0	0	0	0	0	0	108.256	0	0	0	0	-	-	852	380
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	500.794	0	0	0	0	-	-	3.472	1.699
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	753.199	0	0	0	0	-	-	4.419	2.313

Importe pendiente derechos de crédito

CUADRO A.1.1

Miles de euros

FONDO	CEDULAS HIPOTECARIAS, TERRITORIALES Y DE INTERNACIONALIZACIÓN	PRÉSTAMOS A PROMOTORES	PRÉSTAMOS A EMPRESAS, CORPORATIVOS Y PYMES	DEUDA SUBORDINADA Y BONOS DE TESORERÍA	AAPP	CONSUMO Y AUTOMOCIÓN	Cuentas a COBRAR Y CUOTAS DE LEASING	DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS	BONOS DE TITULIZACIÓN	OTROS	PAGARÉS	PRIVADOS	DUDOSOS - DETERIORO	INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES	
															HIPOTECARIOS
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE	0	0	0	0	0	714.386	0	0	0	0	-	-	2.630	2.408	
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	523.973	0	0	0	0	-	-	6.978	493	
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	798.007	0	0	0	0	-	-	8.049	707	
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	2.336.918	0	0	0	0	-	-	11.841	1.113	
BBVA LEASING 1, FTA	0	0	0	0	0	0	1.850	0	0	0	-	-	0	4	
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	2.312.795	0	0	0	-	-	0	3.757	
BBVA RMBS 1, FTA	508.250	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	14.370	243	
BBVA RMBS 14, FTA	276.971	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	722	355	
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	865.771	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.471	462	
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	1.300.785	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.976	527	
BBVA RMBS 2, FTA	952.873	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	28.728	439	
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	1.925.711	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.994	475	
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	9.945.306	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	27.943	5.081	
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	1.279.329	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.940	287	
BBVA RMBS 3, FTA	876.453	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	40.613	760	
BBVA RMBS 5 FTA	1.497.893	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	25.401	1.027	
BBVA RMBS 9, FTA	532.305	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.364	323	
BBVA-6 FTPYME FTA	0	0	0	1.346	0	0	0	0	0	0	-	-	-95	1	
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	115.422	0
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	94.802	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.286	154	
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	0	0	0	29.279	0	0	0	0	0	0	-	-	2.164	48	
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	0	0	0	14.643	0	0	0	0	0	0	-	-	4.500	25	
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	455.521	0	0	0	0	-	-	6.455	2.719	
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	1.929.094	0	0	0	0	-	-	4.369	9.621	
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	156.158	0	1.435	
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	255.804	0	0	0	-	-	510	311	
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	524.865	0	0	0	0	0	0	-	-	14.987	2.950	
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	611.434	0	0	0	0	0	0	-	-	8.333	3.277	
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	849.226	0	0	0	0	0	0	-	-	13.087	3.773	
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	2.917.171	0	0	0	0	0	0	-	-	932	9.572	
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	6.942.022	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	95.400	24.871	
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	1.462.480	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	25.578	4.285	
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	1.282.674	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	36.650	4.365	
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	63.672	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	140	
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE	0	0	0	0	0	1.183.382	0	0	0	0	-	-	366	4.632	
CEDULAS TDA 6, FTA	0	3.000.000	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	70.512	
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	94.422	0	471	
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	35.000	0	3.720	
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	597.817	0	0	0	0	-	-	6.137	286	
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	30.500	0	9	
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	6.001	0	299	
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	21.142	0	266	
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	592	-89	13	
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	0	0	0	843	0	0	0	0	0	0	-	-	2.447	5	
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	54.102	0	0	
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	393.159	0	0	

Importe pendiente derechos de crédito

CUADRO A.1.1

Miles de euros

FONDO	CEDULAS HIPOTECARIAS, TERRITORIALES Y DE INTERNACIONALIZACIÓN		PRÉSTAMOS A PROMOTORES	PRÉSTAMOS A EMPRESAS, CORPORATIVOS Y PYMES	DEUDA SUBORDINADA Y BONOS DE TESORERÍA	AAPP	CONSUMO Y AUTOMOCIÓN	CUENTAS A COBRAR Y CUOTAS DE LEASING	DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS	BONOS DE TITULIZACIÓN	OTROS	PAGARÉS	PRIVADOS	DUDOSOS - DETERIORO	INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES
	HIPOTECARIOS	INTERNACIONALIZACIÓN													
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	0	0	0	79.111	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.245	288
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	0	0	0	59.811	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.701	219
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	0	0	0	0	0	0	3.639	0	0	0	0	-	-	0	4
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	256.903	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.381	562
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	511.889	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	11.331	1.072
FTA UCI 11	71.055	0	0	0	0	0	2.729	0	0	0	0	-	-	7.442	552
FTA UCI 14	169.236	0	0	0	0	0	0	0	0	0	12.738	-	-	32.464	1.806
FTA UCI 16	299.091	0	0	0	0	0	0	0	0	0	14.225	-	-	55.068	2.780
FTA, UCI 15	217.476	0	0	0	0	0	13.316	0	0	0	0	-	-	38.578	1.756
FTA, UCI 17	272.557	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	50.761	2.792
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	6.564.335	-	-	0	0
FTH UCI 12	106.388	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	10.921	892
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	0	0	0	864.392	0	0	0	0	0	0	0	-	-	5.236	2.722
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	349.211	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	717	15
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	355.891	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	43
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO X	467.886	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	44
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER	0	0	0	0	0	0	159.079	0	0	0	0	-	-	3.747	2.690
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER	0	0	0	0	0	0	386.381	0	0	0	0	-	-	0	1.422
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	12.189	0	27
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	228.847	130.676	889
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	397.239	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	44
FTA2015, FTA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	20.064	336.557	263
FTPYME TDA CAM 4, FTA	0	0	0	34.871	0	0	0	0	0	0	0	-	-	9.549	54
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	15.063	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	211	17
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	0	0	0	2.560	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	1
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	92.555	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	6.920	14
HIPOCAT 10, FTA	136.360	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.954	71
HIPOCAT 11, FTA	152.020	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.759	76
HIPOCAT 9, FTA	92.139	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.065	32
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	38.874	0	0
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	456.553	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.622	1.741
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	483.704	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	5.686	1.922
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	9.897	0	0
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	25.996	0	0
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	20.672	1.465	1.377
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	64.751	0	2.700
IM ANDBANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	94.752	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	133	159
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	326.948	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.917	947
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	455.737	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.503	1.274

Importe pendiente derechos de crédito

CUADRO A.1.1

Miles de euros

FONDO	HIPOTECARIOS	CEDULAS HIPOTECARIAS, TERRITORIALES Y DE INTERNACIONALIZACIÓN	PRÉSTAMOS A PROMOTORES	PRÉSTAMOS A EMPRESAS, CORPORATIVOS Y PYMES	DEUDA SUBORDINADA Y BONOS DE TESORERÍA	AAPP	CONSUMO Y AUTOMOCIÓN	CUENTAS A COBRAR Y CUOTAS DE LEASING	DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS	BONOS DE TITULIZACIÓN	OTROS	PAGARÉS	PRIVADOS	DUDOSOS - DETERIORO	INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	390.509	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.566	3.582
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	515.849	0	0	0	0	0	0	0	-	-	7.286	3.918
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	158.900	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.041	2.516
IM BCG RMBS 2, FTA	559.083	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	6.406	1.199
IM CAJAMAR 3, FTA	131.005	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	539	278
IM CAJAMAR 4, FTA	140.133	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	810	303
IM CAJAMAR 5, FTA	143.371	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.035	405
IM CAJAMAR 6, FTA	366.693	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.485	858
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	176.178	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.127	327
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	83.394	0	594
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	12.402	9.891	0
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	371.237	0	3.162
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	23.504	0	32
IM PASTOR 2, FTH	30.966	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.308	0
IM PASTOR 3, FTH	56.520	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	18.039	1
IM PASTOR 4, FTA	80.906	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	21.703	0
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	20.679	0	188
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	8.204	0	0
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	238.812	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	8.406	480
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	232.438	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	6.939	491
MADRID RMBS I, FTA	361.650	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	21.390	768
MADRID RMBS II, FTA	316.062	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	20.723	729
MADRID RMBS III FTA	681.697	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	54.518	1.420
MADRID RMBS IV, FTA	511.342	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	24.177	1.023
MBS BANCAJA 3, FTA	63.154	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	6.996	191
MBS BANCAJA 4, FTA	189.333	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	25.865	582
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	98.620	0	1.070
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	818.569	0	0	0	0	-	-	7.577	5.176
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	8.479	0
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	44.895	0	425
PENSIUM ESG I, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2.065	0	65
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	17.003	381	104
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	1.306.004	0	0	0	0	-	-	2.643	1.777
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	0	5.115.000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	159.376
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACIÓN	453.497	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	64
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	119.998	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	68.686	843
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	3.014.233	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	51.306	9.424
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	4.017.247	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	58.997	11.246
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	201.957	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	6.913	472
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	111.713	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.228	257
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	300.479	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.430	650
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	396.052	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.957	829
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	215.269	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.146	334
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	62.433	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	989	128
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	261.795	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.978	841
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	177.835	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.567	348

Importe pendiente derechos de crédito

CUADRO A.1.1

Miles de euros

FONDO	HIPOTECARIOS	CEDULAS HIPOTECARIAS, TERRITORIALES Y DE INTERNACIONALIZACIÓN	PRÉSTAMOS A PROMOTORES	PRÉSTAMOS A EMPRESAS, CORPORATIVOS Y PYMES	DEUDA SUBORDINADA Y BONOS DE TESORERÍA	AAPP	CONSUMO Y AUTOMOCIÓN	CUENTAS A COBRAR Y CUOTAS DE LEASING	DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS	BONOS DE TITULIZACIÓN	OTROS	PAGARÉS	PRIVADOS	DUDOSOS - DETERIORO	INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	41.418	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	468	67
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	26.959	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	70	62
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	136.460	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	953	302
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	587.441	0	0	0	0	-	-	6	3.138
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	88.181	0	0	0	0	-	-	1.362	93
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	423.484	0	0	0	0	-	-	5.029	410
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	180.699	0	0
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	27.237	0
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO	0	0	0	0	0	0	208.679	0	0	0	0	-	-	2.329	940
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO	0	0	0	0	0	0	157.236	0	0	0	0	-	-	1.033	614
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01,	0	0	0	0	0	0	681.693	0	0	0	0	-	-	0	5.039
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO	0	0	0	0	0	0	590.591	0	0	0	0	-	-	0	2.563
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	595.421	0	0	0	0	-	-	0	3.221
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	681.323	0	0	0	0	-	-	0	3.816
SLF, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	16.132	61.087	0
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	46.795	11.374	0
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	453.830	0	0
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	15.454.103	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	53.948	47.477
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	395.935	0	78
TDA 19 - MIXTO, FTA	27.885	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	208	68
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	65.669	0
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	85.323	0
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	12.572	0
TDA 22 - MIXTO, FTA	37.075	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	5.302	88
TDA 24, FTA	34.833	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	12.057	102
TDA 25, FTA	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	393	0
TDA 26 - MIXTO, FTA	69.171	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.080	213
TDA 27, FTA	122.884	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	20.160	303
TDA 28, FTA	86.648	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	22.922	267
TDA 29, FTA	125.807	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.582	389
TDA 30, FTA	87.998	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.723	360
TDA CAJAMAR 2, FTA	75.689	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	442	163
TDA CAM 4, FTA	74.719	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	8.635	120
TDA CAM 5, FTA	213.606	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	19.282	342
TDA CAM 6, FTA	151.543	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	17.697	256
TDA CAM 7, FTA	246.264	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	22.044	382
TDA CAM 8, FTA	218.473	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	21.809	390
TDA CAM 9, FTA	232.672	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	21.993	393
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	92.269	0
TDA IBERCAJA 3, FTA	114.092	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	442	36
TDA IBERCAJA 4, FTA	176.305	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	926	74
TDA IBERCAJA 5, FTA	188.931	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.557	76
TDA IBERCAJA 6, FTA	317.104	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.048	139
TDA IBERCAJA 7, FTA	604.897	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.509	239
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	39.179	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	245	42
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	3.314.630	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	67.369	3.458
TDA TARRAGONA 1, FTA	50.026	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.107	192

Importe pendiente derechos de crédito

CUADRO A.1.1

Miles de euros

FONDO	HIPOTECARIOS	CEDULAS HIPOTECARIAS, TERRITORIALES Y DE INTERNACIONALIZACIÓN	PRÉSTAMOS A PROMOTORES	PRÉSTAMOS A EMPRESAS, CORPORATIVOS Y PYMES	DEUDA SUBORDINADA Y BONOS DE TESORERÍA	AAPP	CONSUMO Y AUTOMOCIÓN	CUENTAS A COBRAR Y CUOTAS DE LEASING	DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS	BONOS DE TITULIZACIÓN	OTROS	PAGARÉS	PRIVADOS	DUDOSOS - DETERIORO	INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES	
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	148.637	0
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	71.852	0	0
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	133.653	438	1.089
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	97.717	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.744	302	
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	25.786	230.643	224
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	13.489	791	168
Total 31/12/2023	78.798.784	11.660.000	0	7.054.810	0	0	19.127.786	2.570.449	0	0	6.591.298	0	3.378.307	2.976.906	611.108	
Total 31/12/2022	88.443.608	13.260.000	0	6.268.064	0	0	16.117.635	403.393	0	0	8.460.677	0	3.185.568	3.282.286	497.923	
%Variación	-10,91	-12,07	-	12,55	-	-	18,68	537,21	-	-	-22,09	-	6,05	-9,32	22,73	

FONDO	TAA (1)	% DEUDA/VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	POR DEUDOR (9)	TASA DE CONCENTRACIÓN	
										GEOGRÁFICA	
										ÁREA	PORCENTAJE
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	13,27	34,58	0,79	0,00	0,00	16,46	15,73	2,29	2,52	CATALUÑA	70,52
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	7,08	39,79	2,27	18,95	7,99	13,43	14,44	3,62	4,15	ANDALUCÍA	79,01
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	8,73	42,72	1,07	0,00	0,00	13,34	19,31	2,84	0,36	PAÍS VASCO	37,96
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	11,40	25,18	0,15	0,33	34,80	10,37	18,12	2,80	2,50	MADRID	21,83
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	9,77	20,54	0,03	0,00	0,00	8,71	19,64	2,53	4,63	MADRID	28,24
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	11,02	22,08	0,14	0,83	6,01	9,26	19,19	2,74	1,81	CATALUÑA	22,35
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	10,32	21,43	0,37	0,74	13,95	9,13	19,29	2,68	1,50	MADRID	28,56
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	10,29	25,05	0,31	0,14	43,47	10,75	17,74	2,58	1,87	CATALUÑA	22,42
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	11,01	25,26	0,16	0,32	64,81	11,28	17,39	2,78	1,87	MADRID	24,32
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	11,11	25,97	0,57	0,00	100,00	11,68	17,00	2,66	2,52	ANDALUCÍA	22,70
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	10,74	32,75	0,48	0,38	54,11	14,66	15,04	2,67	0,60	CATALUÑA	20,89
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	11,86	30,36	0,47	0,30	64,11	14,23	14,41	2,65	2,13	CATALUÑA	21,61
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	11,71	30,72	0,60	0,49	36,47	13,33	15,74	2,87	1,58	MADRID	27,13
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	8,40	34,52	0,47	1,01	13,38	8,87	20,59	2,73	1,12	PAÍS VASCO	65,85
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	9,03	36,54	1,22	1,23	25,71	9,98	19,57	2,66	1,24	PAÍS VASCO	55,82
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	10,58	34,70	0,74	4,40	16,22	10,14	19,42	2,78	2,46	NAVARRA	42,58
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	7,13	40,74	0,47	0,68	0,00	15,34	17,65	3,28	4,50	PAÍS VASCO	89,62
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	10,54	35,02	0,19	0,67	1,57	11,40	19,72	3,02	1,56	PAÍS VASCO	50,70
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	9,18	41,03	0,85	3,65	7,47	13,71	18,82	3,26	0,96	PAÍS VASCO	41,44
BANCAJA 10, FTA	7,37	40,25	7,11	12,61	0,22	13,95	18,05	3,29	0,46	C.VALENCIANA	30,72
BANCAJA 11, FTA	7,33	44,77	7,08	12,05	0,04	17,24	17,49	3,20	0,67	C.VALENCIANA	33,14
BANCAJA 13, FTA	6,61	52,43	2,97	8,71	0,10	21,13	16,43	3,17	0,44	C.VALENCIANA	34,00
BANCAJA 8, FTA	7,58	30,41	5,41	8,45	1,18	9,41	19,63	3,64	1,35	C.VALENCIANA	33,40
BANCAJA 9, FTA	6,83	34,22	8,60	12,35	0,02	10,72	18,87	3,45	1,19	C.VALENCIANA	32,47
BANKINTER 10, FTA	12,31	25,42	1,12	0,12	0,00	11,13	19,54	2,99	1,76	MADRID	35,20
BANKINTER 11, FTH	12,45	25,36	1,72	0,16	0,00	11,67	19,41	2,97	2,94	MADRID	31,22
BANKINTER 13 FTA	13,67	30,73	2,35	0,60	0,00	13,58	18,16	3,07	1,53	MADRID	30,98
BBVA RMBS 1, FTA	9,05	44,62	2,89	4,55	0,03	12,56	18,70	3,43	0,46	CATALUÑA	25,78
BBVA RMBS 14, FTA	5,30	38,08	0,26	0,01	0,00	11,24	13,93	2,37	0,43	MADRID	29,43
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	14,62	53,53	0,28	0,08	0,00	23,26	8,76	4,83	0,54	MADRID	17,73
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	9,17	55,32	0,23	0,02	0,00	23,71	7,21	3,51	0,54	CATALUÑA	29,66
BBVA RMBS 2, FTA	8,21	37,44	2,99	3,01	0,01	11,49	18,74	3,50	0,28	CATALUÑA	21,16
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	6,77	60,22	0,16	0,03	0,00	22,68	5,12	2,51	0,40	CATALUÑA	29,04
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	8,43	61,58	0,30	0,01	0,00	20,44	12,78	3,63	0,10	CATALUÑA	21,91
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	3,92	64,84	0,15	0,00	0,00	23,92	3,57	1,82	0,73	CATALUÑA	32,72
BBVA RMBS 3, FTA	7,69	61,42	4,84	7,15	0,07	18,01	17,53	3,83	0,41	CATALUÑA	23,22
BBVA RMBS 5 FTA	8,04	65,11	1,85	3,59	0,02	20,09	16,72	3,88	0,32	CATALUÑA	20,39
BBVA RMBS 9, FTA	7,65	69,68	0,96	0,68	0,00	21,90	14,94	3,96	0,66	ANDALUCÍA	22,57
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	8,35	30,06	3,35	0,06	0,00	9,12	19,69	3,22	2,00	CATALUÑA	98,76
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	8,37	47,36	1,67	1,70	11,94	16,82	15,86	4,39	0,13	CATALUÑA	28,87

FONDO	TAA (1)	% DEUDA/VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	POR DEUDOR (9)	TASA DE CONCENTRACIÓN	
										GEOGRÁFICA	
										ÁREA	PORCENTAJE
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	7,22	50,75	2,12	1,33	18,67	18,62	11,11	3,79	0,60	ANDALUCÍA	21,81
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	7,16	36,90	3,18	1,54	23,40	15,24	13,61	4,21	0,72	CATALUÑA	38,00
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	14,49	32,62	0,00	0,00	0,00	14,50	17,76	2,59	4,98	CATALUÑA	80,64
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	6,84	57,71	2,62	6,34	0,02	11,79	18,96	4,38	1,33	CATALUÑA	17,42
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	6,63	80,36	3,41	14,53	0,04	16,47	18,10	4,29	0,68	ANDALUCÍA	17,98
FTA UCI 11	7,74	34,32	9,41	0,03	0,00	9,54	20,34	4,46	1,82	MADRID	21,09
FTA UCI 14	7,05	43,44	16,80	0,41	0,00	13,01	19,07	4,20	1,23	MADRID	22,16
FTA UCI 16	6,41	47,52	18,02	0,59	0,00	17,12	17,89	4,37	1,09	ANDALUCÍA	25,01
FTA, UCI 15	6,23	46,01	16,74	0,46	0,00	14,77	18,45	4,41	1,13	ANDALUCÍA	23,41
FTA, UCI 17	6,26	48,40	19,27	0,78	0,00	17,86	17,35	4,45	1,40	ANDALUCÍA	25,14
FTH UCI 12	6,71	36,89	9,50	0,14	0,00	12,09	19,48	4,43	1,88	MADRID	22,59
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	8,50	60,44	0,25	0,05	0,00	22,32	7,13	4,32	1,60	MADRID	33,25
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	7,55	57,66	0,05	0,06	0,00	23,15	7,02	3,18	1,41	CATALUÑA	38,77
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO X	6,79	64,28	0,06	0,01	0,00	23,94	6,92	3,11	1,26	CATALUÑA	33,46
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	5,71	64,47	0,09	0,14	0,00	24,08	5,86	2,84	1,38	CATALUÑA	35,06
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	6,15	17,36	1,38	1,80	3,54	3,78	17,58	2,31	3,94	CATALUÑA	75,30
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	7,03	32,86	6,95	20,14	8,41	13,00	17,68	2,56	3,60	CATALUÑA	29,87
HIPOCAT 10, FTA	7,35	42,44	2,57	22,30	0,38	10,54	18,93	3,08	1,66	CATALUÑA	70,01
HIPOCAT 11, FTA	6,10	55,67	3,28	29,92	0,50	13,10	18,20	3,19	1,97	CATALUÑA	70,65
HIPOCAT 9, FTA	7,30	34,34	2,19	12,48	0,89	10,19	19,23	3,15	1,80	CATALUÑA	69,61
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	15,86	45,92	0,56	0,33	0,00	18,29	14,14	2,41	1,03	GALICIA	44,32
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	13,69	48,98	1,15	0,40	1,02	17,20	15,50	2,55	0,89	GALICIA	43,27
IM ANDBANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	38,37	45,66	0,14	0,00	0,00	18,00	3,03	3,10	5,60	MADRID	41,29
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	10,35	51,54	0,59	0,00	0,00	19,04	13,13	4,10	1,22	ANDALUCÍA	38,21
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	9,01	61,99	0,34	0,00	0,00	21,41	7,82	3,84	0,88	ANDALUCÍA	35,44
IM BCG RMBS 2, FTA	9,32	43,32	1,13	0,00	0,00	21,07	14,85	3,71	0,81	GALICIA	21,25
IM CAJAMAR 3, FTA	7,28	27,35	0,41	0,00	0,00	10,72	18,93	3,42	1,43	ANDALUCÍA	34,09
IM CAJAMAR 4, FTA	6,25	29,97	0,57	0,00	0,00	11,01	18,25	3,35	1,40	ANDALUCÍA	39,50
IM CAJAMAR 5, FTA	8,05	30,09	0,72	0,00	0,00	11,29	17,77	3,36	1,55	ANDALUCÍA	45,67
IM CAJAMAR 6, FTA	6,00	35,89	0,94	0,00	0,00	14,39	17,05	3,38	0,79	ANDALUCÍA	38,06
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	9,08	45,74	1,87	0,00	0,00	15,51	16,96	3,14	2,44	ASTURIAS	67,81
IM PASTOR 2, FTH	10,03	19,92	14,07	0,00	0,00	6,35	21,06	2,83	4,05	CATALUÑA	31,89
IM PASTOR 3, FTH	10,89	35,62	54,65	0,00	0,00	9,96	19,44	3,24	4,20	CATALUÑA	42,41
IM PASTOR 4, FTA	9,43	36,55	49,98	0,00	0,00	11,54	18,51	3,10	2,96	CATALUÑA	29,51
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	9,24	54,35	3,40	9,02	0,00	16,43	16,83	3,87	1,73	MADRID	52,90
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	8,46	58,35	2,88	6,24	0,00	17,20	16,78	3,84	1,85	MADRID	53,34
MADRID RMBS I, FTA	11,16	55,16	6,40	20,42	0,00	12,26	18,52	4,16	0,89	MADRID	69,96
MADRID RMBS II, FTA	11,16	55,02	6,30	21,65	0,00	12,29	18,52	4,14	1,03	MADRID	69,95
MADRID RMBS III, FTA	9,32	60,66	7,58	20,31	0,13	15,56	17,92	3,87	0,55	MADRID	65,78
MADRID RMBS IV, FTA	9,59	57,44	4,56	22,99	0,00	16,08	17,48	3,91	0,94	MADRID	67,51

FONDO	TAA (1)	% DEUDA/VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	POR DEUDOR (9)	TASA DE CONCENTRACIÓN	
										GEOGRÁFICA	
										ÁREA	PORCENTAJE
MBS BANCAJA 3, FTA	8,25	27,50	9,96	5,60	0,27	8,87	18,78	3,37	2,85	C.VALENCIANA	42,65
MBS BANCAJA 4, FTA	8,58	30,30	12,04	7,17	0,01	10,31	17,92	3,39	1,84	C.VALENCIANA	43,28
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACION	5,99	60,39	0,10	0,00	0,00	22,97	9,86	3,25	1,41	CATALUÑA	27,88
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	3,83	93,12	38,57	0,00	0,00	18,98	16,04	4,04	3,29	GALICIA	21,09
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	7,70	86,04	2,69	0,02	16,43	24,95	0,05	4,18	0,53	MADRID	25,98
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	6,29	88,83	2,08	0,01	0,00	20,47	1,11	4,31	0,26	ANDALUCÍA	22,01
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	7,84	32,28	3,34	1,73	0,00	11,06	18,03	3,35	0,93	C.VALENCIANA	37,02
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	6,98	26,51	2,81	0,59	0,00	9,08	19,00	3,42	1,40	ANDALUCÍA	31,50
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	8,43	33,21	1,45	0,56	0,00	12,96	17,12	3,33	0,81	C.VALENCIANA	32,21
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	7,99	34,26	1,23	0,44	0,00	13,60	16,72	3,40	0,68	C.VALENCIANA	36,26
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	7,13	33,16	1,43	0,05	0,00	13,38	16,50	3,70	1,05	C.LA MANCHA	36,49
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	10,04	36,91	1,56	0,00	0,00	14,97	14,38	3,42	3,49	ARAGÓN	88,60
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	14,19	53,12	1,12	0,00	0,00	19,12	8,13	4,05	1,29	CANARIAS	41,76
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	9,88	35,37	0,87	0,00	0,00	15,22	14,49	3,55	1,20	ANDALUCÍA	34,36
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	15,32	38,13	1,11	0,00	0,00	15,29	14,47	3,49	4,81	C.LEÓN	55,66
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	16,89	44,84	0,26	0,00	0,00	18,93	11,97	4,06	6,42	ARAGÓN	52,39
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	13,18	45,67	0,69	0,00	0,00	16,65	10,60	4,11	1,81	ARAGÓN	87,94
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	15,50	56,56	0,35	0,00	0,00	25,45	6,29	3,36	0,06	CATALUÑA	29,85
TDA 19 - MIXTO, FTA	6,32	23,07	0,73	0,00	0,00	7,12	21,22	3,51	2,81	CATALUÑA	45,05
TDA 22 - MIXTO, FTA	5,94	36,09	12,08	8,79	0,07	9,90	20,61	3,44	2,86	CATALUÑA	43,13
TDA 24, FTA	6,48	35,41	25,54	23,28	0,18	8,59	19,86	3,88	3,28	C.LA MANCHA	44,96
TDA 26 - MIXTO, FTA	8,66	28,52	5,43	0,06	0,00	9,54	18,96	3,32	3,47	BALEARES	30,83
TDA 27, FTA	6,65	35,86	13,68	19,25	0,09	12,85	18,76	3,75	1,53	CATALUÑA	36,89
TDA 28, FTA	4,58	47,66	23,68	31,61	0,07	17,08	17,98	4,11	2,68	CATALUÑA	47,54
TDA 29, FTA	8,27	36,90	3,47	0,00	0,00	13,95	17,85	3,34	2,34	BALEARES	37,36
TDA 30, FTA	5,94	38,36	1,92	0,00	0,00	15,63	17,33	3,46	2,97	BALEARES	50,23
TDA CAJAMAR 2, FTA	7,81	25,13	0,56	0,00	0,00	8,74	19,59	3,86	1,64	ANDALUCÍA	39,77
TDA CAM 4, FTA	6,66	21,42	10,26	1,02	0,00	5,41	21,05	3,14	1,49	C.VALENCIANA	48,86
TDA CAM 5, FTA	6,65	31,62	8,27	2,60	0,00	9,66	19,93	3,12	0,72	C.VALENCIANA	36,17
TDA CAM 6, FTA	6,78	36,87	10,57	5,23	0,00	11,49	18,90	3,18	1,02	C.VALENCIANA	41,45
TDA CAM 7, FTA	6,69	38,11	8,27	4,47	0,07	12,74	18,60	3,09	1,05	C.VALENCIANA	35,56
TDA CAM 8, FTA	7,30	33,99	9,45	3,60	0,00	11,56	19,08	3,15	1,25	C.VALENCIANA	41,77
TDA CAM 9, FTA	6,98	38,19	8,62	4,63	0,02	14,27	17,63	3,29	1,27	C.VALENCIANA	41,34
TDA IBERCAJA 3, FTA	9,28	29,40	0,38	0,00	99,86	10,10	19,37	3,73	1,21	MADRID	36,61
TDA IBERCAJA 4, FTA	10,24	32,48	0,52	0,03	80,90	10,77	19,12	3,67	1,25	MADRID	30,39
TDA IBERCAJA 5, FTA	9,66	36,85	0,81	0,15	48,90	12,26	18,64	3,68	1,12	MADRID	28,27
TDA IBERCAJA 6, FTA	8,17	39,02	0,63	0,11	51,62	14,79	17,87	3,73	0,93	MADRID	29,88
TDA IBERCAJA 7, FTA	9,70	41,01	0,74	0,01	90,56	17,07	16,70	3,61	0,61	MADRID	34,34
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	6,94	20,07	0,62	0,00	0,00	5,27	16,93	2,25	1,56	MADRID	42,46

FONDO	TAA (1)	% DEUDA/VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	POR DEUDOR (9)	TASA DE CONCENTRACIÓN	
										GEOGRÁFICA	
										ÁREA	PORCENTAJE
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	8,30	58,04	2,03	0,00	0,00	21,05	14,29	3,06	0,34	CATALUÑA	33,70
TDA TARRAGONA 1, FTA	7,56	38,15	2,10	3,75	0,00	13,77	18,82	3,51	3,22	CATALUÑA	94,70
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	8,37	26,90	4,69	1,61	0,00	8,85	18,66	3,10	2,25	C.VALENCIANA	69,93
Total 31/12/2023	9,69	55,08	2,10	1,82	5,52	19,57	11,62	3,57	0,55		30,47
Total 31/12/2022	6,60	57,12	1,68	1,65	7,74	20,07	11,07	1,16	0,53		30,54
%Variación	46,82	-3,57	25,00	10,30	-28,68	-2,49	4,97	207,76	3,77		-0,23

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

(6) Vida residual media ponderada valorada en años

(7) Antigüedad media ponderada valorada en años

(8) Tipo de interés medio ponderado

(9) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

Fondos de titulización públicos - bonos: cédulas hipotecarias, territoriales y de internacionalización

FONDO	TAA (1)	VIDA RESIDUAL (2)	ANTIGÜEDAD (3)	INTERES (4)	TASA DE CONCENTRACIÓN	
					GEOGRÁFICA	
					ÁREA	PORCENTAJE
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	0,00	0,00	3,50	4,76	C.LEÓN	29,45
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	0,00	1,50	18,51	3,75	GALICIA	20,51
CEDULAS TDA 6, FTA	0,00	1,39	18,63	3,88	MADRID	21,67
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	0,00	6,25	17,84	4,25	ANDALUCÍA	27,17
Total 31/12/2023	0,00	3,37	16,25	4,14		24,93
Total 31/12/2022	0,00	4,15	16,98	4,08		24,18
%Variación	-	-18,80	-4,30	1,47		3,10

Información sobre los encabezados

- (1) Tasa de amortización anticipada
- (2) Vida residual media ponderada valorada en años
- (3) Antigüedad media ponderada valorada en años
- (4) Tipo de interés medio ponderado

FONDO	TAA (1)	% DEUDA / VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	TASA DE CONCENTRACIÓN		
									GEOGRÁFICA		
									POR DEUDOR (9)	ÁREA	PORCENTAJE

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
- (6) Vida residual media ponderada valorada en años
- (7) Antigüedad media ponderada valorada en años
- (8) Tipo de interés medio ponderado
- (9) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

FONDO	TAA (1)	% DEUDA / VT		DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	POR DEUDOR (9)	TASA DE CONCENTRACIÓN	
		(2)	SECTOR									
			CNAE								PORCENTAJE	
BBVA-6 FTPYME FTA	0,48	24,90	94,40	38,30	0,00	3,36	18,21	4,34	54,21	23.FABRICACIÓN DE OTROS PRODUCTOS MINERALES NO METÁLICOS	17,92	
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	9,17	29,19	6,96	1,71	0,00	10,08	17,87	3,42	11,90	70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL	21,57	
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	7,58	29,52	24,17	2,27	0,00	7,58	18,48	3,43	23,19	70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL	39,59	
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	9,81	30,12	3,37	7,27	5,87	7,06	8,59	4,46	11,79	68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS	16,98	
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	10,57	36,55	2,03	5,20	9,95	5,99	5,76	3,86	15,22	55.SERVICIOS DE ALOJAMIENTO	17,11	
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	7,25	36,50	2,32	2,27	11,87	4,61	4,21	3,41	10,35	01.AGRICULTURA, GANADERÍA, CAZA Y SERVICIOS RELACIONADOS CON LAS MISMAS	14,09	
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,70	0,00	0,06	0,00	0,00	6,00	1,46	4,16	3,61	01.AGRICULTURA, GANADERÍA, CAZA Y SERVICIOS RELACIONADOS CON LAS MISMAS	15,07	
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	1,72	30,94	88,09	26,67	0,00	4,79	18,89	4,05	50,01	68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS	25,01	
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	9,87	29,25	4,26	24,63	6,45	11,35	18,19	4,33	6,40	68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS	18,93	
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	8,83	31,41	6,66	22,73	6,88	12,03	17,54	4,34	5,23	47.COMERCIO AL POR MENOR, EXCEPTO DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS	21,28	
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	2,11	28,71	3,81	0,00	0,00	4,58	6,53	4,71	9,38	C. INDUSTRIA MANUFACTURERA	1,48	
FTPYME TDA CAM 4, FTA	6,69	30,56	27,93	5,70	0,00	6,92	16,30	3,23	13,65	74.OTRAS ACTIVIDADES PROFESIONALES, CIENTÍFICAS Y TÉCNICAS	18,29	
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	1,42	15,26	12,44	86,72	2,24	5,30	18,30	3,42	66,64	29.FABRICACIÓN DE VEHÍCULOS DE MOTOR, REMOLQUES Y SEMIRREMOLQUES	37,07	
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	5,93	48,94	1,09	0,00	0,00	6,54	5,71	4,61	5,21	11. FABRICACIÓN DE BEBIDAS	20,05	
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	5,42	43,48	1,76	0,00	0,00	7,30	4,23	3,64	4,39	01.AGRICULTURA, GANADERÍA, CAZA Y SERVICIOS RELACIONADOS CON LAS MISMAS	24,90	
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	7,67	34,21	1,68	0,00	0,00	5,80	7,56	4,59	6,54	01.AGRICULTURA, GANADERÍA, CAZA Y SERVICIOS RELACIONADOS CON LAS MISMAS	46,06	
Total 31/12/2023	4,28	21,08	1,87	1,86	2,88	6,00	4,46	4,12	7,22		15,55	
Total 31/12/2022	4,15	36,96	2,44	1,94	10,78	5,84	5,30	2,40	7,40		14,09	
%Variación	3,13	-42,97	-23,36	-4,12	-73,28	2,74	-15,85	71,67	-2,43		10,36	

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

FONDO	TAA (1)	% DEUDA / VT		FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	POR DEUDOR (9)	TASA DE CONCENTRACIÓN	
		(2)	DUDOSOS (3)							SECTOR	
										CNAE	PORCENTAJE

(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) Tipo de interés medio ponderado

(9) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

FONDO	TAA (1)	% DEUDA / VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	TASA DE CONCENTRACIÓN		
									POR DEUDOR (9)	GEOGRÁFICA	
										ÁREA	PORCENTAJE

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) Tipo de interés medio ponderado

(9) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

FONDO	TAA (1)	% DEUDA / VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	TASA DE CONCENTRACIÓN		
									POR DEUDOR (9)	GEOGRÁFICA	
										ÁREA	PORCENTAJE

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) Tipo de interés medio ponderado

(9) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

FONDO	TAA (1)	% DEUDA / VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	TASA DE CONCENTRACIÓN		
									POR DEUDOR (9)	GEOGRÁFICA	
										ÁREA	PORCENTAJE
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	15,04	0,00	2,13	0,02	0,02	1,79	3,47	7,31	1,73	CATALUÑA	21,16
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	13,14	0,00	6,35	6,08	11,32	1,65	4,91	8,34	0,48	ANDALUCÍA	22,75
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	16,09	0,00	1,19	1,56	18,05	2,41	3,59	9,43	0,18	ANDALUCÍA	19,91
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	10,71	0,00	0,21	0,50	1,98	2,45	2,48	7,08	0,10	CATALUÑA	20,75
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	11,40	0,00	2,97	0,00	0,00	3,14	5,15	7,99	0,15	ANDALUCÍA	19,79
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	13,59	0,00	1,18	0,00	0,00	3,96	3,39	7,35	0,11	ANDALUCÍA	17,51
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	10,29	0,00	1,11	0,00	0,00	5,12	1,94	7,55	0,13	ANDALUCÍA	17,51
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,03	0,00	0,00	6,32	1,02	7,54	0,14	ANDALUCÍA	17,95
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	10,44	0,00	6,99	12,15	3,60	2,86	6,25	6,89	0,22	ANDALUCÍA	19,92
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	9,47	0,00	3,96	0,54	0,00	3,82	4,51	6,65	0,09	ANDALUCÍA	20,06
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACION	9,13	0,00	1,51	0,00	0,00	4,80	2,88	6,30	0,07	ANDALUCÍA	20,09
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	2,87	0,00	0,51	0,00	0,00	6,14	1,54	6,69	0,08	ANDALUCÍA	21,89
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	12,70	0,00	8,23	7,23	0,00	3,11	4,97	7,02	0,13	CATALUÑA	24,72
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	11,80	0,00	5,52	1,58	0,00	3,44	4,20	6,84	0,06	CATALUÑA	26,90
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	8,23	0,00	0,85	0,00	0,00	5,02	2,27	5,68	0,04	CATALUÑA	26,27
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	15,52	0,00	4,07	23,00	6,06	2,03	4,59	7,22	1,54	CATALUÑA	28,18
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	4,23	0,00	0,76	0,33	0,00	4,08	1,73	6,86	0,05	CATALUÑA	31,04
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	12,67	0,00	0,07	0,00	0,00	2,40	2,33	7,53	0,04	CATALUÑA	17,89
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	4,80	3,49	0,00	0,00	10,25	20,04	0,03	ANDALUCÍA	24,01
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	21,20	0,00	0,84	98,17	0,08	4,36	20,72	2,29	7,18	MADRID	38,04
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2	10,70	0,00	7,51	7,84	0,00	2,97	4,95	7,96	0,22	ANDALUCÍA	23,85
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	9,06	0,00	2,07	0,00	0,00	3,92	3,53	6,47	0,13	ANDALUCÍA	23,88
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	21,00	0,00	4,45	0,43	0,00	4,68	2,52	7,41	0,07	CATALUÑA	21,97
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	11,04	0,00	0,71	0,06	2,73	3,01	2,46	3,20	0,06	CATALUÑA	20,53
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE TITULIZACION	2,82	0,00	0,00	0,00	0,00	4,08	3,43	7,22	0,10	ANDALUCÍA	22,02
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	11,40	0,00	25,16	6,54	6,27	2,05	5,74	6,72	0,37	CATALUÑA	37,01
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	10,12	0,00	3,23	0,24	0,00	4,11	2,96	7,03	0,17	CATALUÑA	35,37
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	12,21	0,00	4,66	1,67	0,00	3,08	4,39	7,82	0,17	ANDALUCÍA	22,16

FONDO	TAA (1)	% DEUDA / VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	TASA DE CONCENTRACIÓN		
									POR DEUDOR (9)	GEOGRÁFICA	
										ÁREA	PORCENTAJE
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	9,30	0,00	3,22	0,25	0,00	3,42	4,47	6,86	0,19	ANDALUCÍA	20,94
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	15,13	0,00	0,67	0,00	0,00	4,52	2,25	6,79	0,09	ANDALUCÍA	22,83
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	2,42	0,00	0,80	0,00	0,00	6,26	1,23	8,06	0,09	ANDALUCÍA	20,22
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	18,45	0,00	4,70	0,95	21,73	2,88	4,12	6,88	0,11	MADRID	18,21
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	9,85	0,00	0,30	0,00	0,00	4,68	1,85	6,63	0,14	MADRID	19,58
Total 31/12/2023	9,50	0,00	2,07	1,28	1,27	3,94	3,00	7,07	0,13		23,21
Total 31/12/2022	10,56	0,00	2,07	1,07	4,02	3,74	3,04	7,29	0,17		22,27
%Variación	-10,04	-	0,00	19,63	-68,41	5,35	-1,32	-3,02	-23,53		4,22

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) Tipo de interés medio ponderado

(9) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

FONDO	TAA (1)	% DEUDA / VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	TASA DE CONCENTRACIÓN		
									POR DEUDOR (9)	SECTOR	
										CNAE	PORCENTAJE
BBVA LEASING 1, FTA	0,15	0,00	97,88	7,05	0,04	2,04	17,86	3,49	7,12	43.ACTIVIDADES DE CONSTRUCCIÓN ESPECIALIZADA	13,27
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	0,49	0,00	0,00	0,00	0,00	4,66	2,79	5,34	7,50	49.TRANSPORTE TERRESTRE Y POR TUBERÍA	22,19
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	3,29	35,77	1,54	3,19	12,80	5,21	8,62	4,42	32,12	68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS	25,58
Total 31/12/2023	0,77	3,56	0,22	0,32	1,28	4,71	3,38	5,25	9,95		22,52
Total 31/12/2022	6,85	39,02	1,62	1,81	18,35	4,99	7,28	2,49	24,02		21,55
%Variación	-88,76	-90,88	-86,42	-82,32	-93,02	-5,61	-53,57	110,84	-58,58		4,50

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) Tipo de interés medio ponderado

(9) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

FONDO	TAA (1)	% DEUDA / VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	TASA DE CONCENTRACIÓN		
									POR DEUDOR (9)	SECTOR	
										CNAE	PORCENTAJE

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) Tipo de interés medio ponderado

(9) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

FONDO	TAA (1)	% DEUDA / VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	TASA DE CONCENTRACIÓN POR DEUDOR (9)
-------	---------	------------------	-------------	--------------	------------------------------	----------------------	----------------	-------------	---

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) Tipo de interés medio ponderado

(9) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

FONDO	TAA (1)	% DEUDA / VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN		ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	TASA DE
					FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)			CONCENTRACIÓN
									POR DEUDOR (9)
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,52	11,29	2,01	100,00
Total 31/12/2023	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,52	11,29	2,01	100,00
Total 31/12/2022	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,46	10,36	1,87	100,00
%Variación	-	-	-	-	-	-21,08	8,98	7,49	0,00

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) Tipo de interés medio ponderado

(9) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

FONDO	TAA (1)	% DEUDA / VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	TASA DE CONCENTRACIÓN POR DEUDOR (9)
-------	---------	------------------	-------------	--------------	------------------------------	-------------------	----------------	-------------	--

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) Tipo de interés medio ponderado
- (9) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

FONDO	TAA (1)	% DEUDA / VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN		ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	TASA DE CONCENTRACIÓN POR DEUDOR (9)
					FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)			
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	2,34	1,82	0,00	0,13	0,17	39,65	36,64
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	5,13	1,04	3,18	5,54
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1,30	0,00	4,73	100,00
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	17,25	0,00	100,00
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	39,04	0,00	0,00	0,00	0,00	5,07	8,83	4,94	100,00
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,19	0,01	39,71
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,00	0,00	0,00	0,00
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	5,63	0,74	7,44	75,44
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,03	0,23	63,87	59,19
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,14	0,10	3,49	100,00
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	7,09	1,96	6,46	100,00
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	7,04	9,31	0,00	65,38
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,18	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	5,85	101,89	51,94	0,07	0,00	22,23	13,09	4,86	1,15
FTA2015, FTA	0,00	88,71	12,66	0,00	0,00	11,46	15,41	1,45	2,59
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	100,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	30,42
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,07	0,10	2,06	5,02
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	7,22	0,00	15,07	0,00	0,00	2,47	3,13	4,06	89,42
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,38	0,00
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,09	0,01	64,04

FONDO	TAA (1)	% DEUDA / VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN		ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	TASA DE CONCENTRACIÓN POR DEUDOR (9)
					FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)			
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	58,70	0,00	0,00	0,00	0,00	4,90	0,00
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,22	4,25	3,04	100,00
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,33	4,50	2,71	100,00
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,26	0,02	33,36
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,11	0,09	0,00	82,00
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	7,67	1,25	4,27	43,84
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,78	11,21	0,00	13,63
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,94	2,74	6,05	100,00
PENSIUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	18,95	1,26	6,43	24,53
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	2,66	0,00	5,48	0,00	0,00	13,08	1,64	7,10	1,16
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	0,00	29,31	0,00	0,00	0,00	0,00	12,79	0,00	7,49
SLF, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	75,22	0,00	0,00	20,36	0,00	5,20	4,88
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,01	98,17
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,30	0,00	7,08	100,00
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	16,21	0,00	0,00	0,00	0,00	5,37	2,74	3,16	0,23
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	10,19	0,00	96,89
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	14,70	0,00	100,00
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	7,91	0,00	100,00
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	0,00	26,01	0,00	0,00	0,00	0,00	12,71	0,00	3,31
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	0,00	30,19	0,00	0,00	0,00	0,00	9,00	0,00	4,35
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,64	1,28	11,37	0,26
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	14,92	47,62	90,13	0,01	0,00	17,25	14,42	3,83	1,38
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	16,17	0,00	10,79	32,89	5,33	2,89	1,28	10,82	2,31
Total 31/12/2023	4,00	18,64	12,24	0,11	0,02	5,89	5,55	3,12	36,32
Total 31/12/2022	7,21	17,03	16,28	0,09	0,18	6,32	6,20	1,89	50,41
%Variación	-44,52	9,45	-24,82	22,22	-88,89	-6,80	-10,48	65,08	-27,95

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) Tipo de interés medio ponderado
- (9) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

Información obligaciones y otros valores negociables

CUADRO A.1.3

Miles de euros

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				
BONOS													
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	73.669	0	0	0	0	41.100	7	0	0	0	0,00	0,44	0,00
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	41.484	7	0	0	0	0,00	6,35	0,00
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	136.525	49	0	0	0	32.721	13	0	0	0	0,00	1,51	0,00
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	358.361	133	0	0	0	99.797	60	0	0	0	0,00	0,84	0,00
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	176.651	90	0	0	0	46.956	31	0	0	-4.077	0,00	0,00	0,00
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	438.250	218	0	0	0	115.239	70	0	0	0	0,00	0,00	0,00
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	398.249	209	0	0	0	85.945	95	0	0	0	0,00	0,00	0,00
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	484.400	246	0	0	0	90.600	87	0	0	0	0,00	0,00	0,00
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	103.695	429	0	0	0	44.441	203	0	0	0	0,00	16,00	0,00
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	11.794	40	4.813	0	0	37.000	97	0	1.000	-5.374	0,00	0,00	0,00
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	1.545.000	44.313	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	2,89
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	2.000.000	37.910	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	2,05
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	642.302	2.020	0	0	0	273.033	1.093	0	0	0	0,00	10,86	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	0	0	0	0	0	148.810	1.333	0	0	0	0,00	3,09	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	53.057	466	0	0	0	7.540	77	0	0	0	0,00	7,98	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	0	0	0	0	0	143.439	276	0	0	0	0,00	5,86	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	186.562	1.009	0	0	0	23.190	149	0	0	0	0,00	3,96	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	0	0	0	0	0	164.604	323	0	0	0	0,00	3,19	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	0	0	0	0	0	205.336	1.144	0	0	0	0,00	8,77	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	127.124	254	0	0	0	22.000	47	0	0	0	0,00	18,54	0,00
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	897.610	1.158	0	0	0	128.230	177	0	0	0	0,00	10,00	0,00
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	220.169	2.839	0	0	0	123.845	1.709	0	0	0	0,00	10,00	0,00
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	225.900	2.913	0	0	0	150.600	2.078	0	0	0	0,00	10,00	0,00
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	43.985	383	0	0	0	85.500	802	0	0	0	0,00	18,53	0,00
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	81.501	665	0	0	0	82.000	718	0	0	0	0,00	6,61	0,00
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	0	0	0	0	0	6.215	9	0	233	-6.270	0,00	0,00	0,00
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	46.012	110	0	0	0	25.600	67	0	0	0	0,00	6,98	0,00
AYT ICO-FVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	31.374	292	0	0	0	7.283	74	0	0	0	81,16	10,42	36,32
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	103.328	832	0	0	0	15.865	137	0	0	0	0,00	5,66	0,00
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	169.244	1.478	0	0	0	82.200	756	0	0	0	0,00	5,49	0,00
BANCAJA 10, FTA	0	0	0	0	0	512.516	2.569	0	21.153	-2.929	0,00	1,43	0,00
BANCAJA 11, FTA	0	0	0	0	0	481.995	3.981	0	27.689	-15.572	0,00	0,00	0,00
BANCAJA 13, FTA	683.078	5.714	0	0	0	311.300	2.971	0	0	0	0,00	13,35	0,00
BANCAJA 8, FTA	50.870	391	0	0	0	102.325	939	0	0	0	0,00	9,15	0,00
BANCAJA 9, FTA	0	0	0	0	0	253.218	182	0	22.467	0	0,00	8,93	0,00

Miles de euros

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 10, FTA	0	0	0	0	0	169.476	230	0	0	0	0,00	6,40	0,00
BANKINTER 11, FTH	0	0	0	0	0	108.457	552	0	0	0	0,00	4,53	0,00
BANKINTER 13 FTA	0	0	0	0	0	250.660	2.305	0	0	0	0,00	4,11	0,00
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	53.757	29	0	0	0	73.000	386	0	0	0	0,00	0,79	0,00
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	487.180	4.686	0	0	0	78.624	1.452	0	0	0	0,00	0,46	0,00
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACION	692.839	4.066	0	0	0	111.775	1.183	0	0	0	0,00	0,45	0,00
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	627.887	1.357	0	0	0	105.833	464	0	0	0	0,00	0,49	0,00
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	368.432	39	0	0	0	192.542	192	0	0	0	0,00	0,45	0,00
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	682.942	5	0	0	0	150.000	29	0	0	0	0,00	10,00	0,00
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	2.319.712	5.026	0	0	0	150.000	488	0	0	0	0,00	6,07	0,00
BBVA LEASING 1, FTA	0	0	0	0	0	34.952	162	0	48	-32.493	0,00	0,00	0,00
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	2.064.000	3.669	0	0	0	336.000	747	0	0	0	0,00	5,00	0,00
BBVA RMBS 1, FTA	0	0	0	0	0	516.708	778	0	0	0	0,00	4,35	0,00
BBVA RMBS 14, FTA	216.943	127	0	0	0	63.000	38	0	0	0	0,00	10,17	0,00
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	677.983	3.723	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	10,55	0,00
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	1.130.381	5.937	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	8,85	0,00
BBVA RMBS 2, FTA	0	0	0	0	0	970.122	1.566	0	0	0	0,00	2,83	0,00
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	1.811.910	10.007	0	0	0	150.000	848	0	0	0	0,00	6,37	0,00
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	9.829.737	47.616	0	0	0	372.000	1.845	0	0	0	0,00	6,08	0,00
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	1.261.998	9.608	0	0	0	42.000	328	0	0	0	0,00	5,37	0,00
BBVA RMBS 3, FTA	0	0	0	0	0	1.018.622	5.138	0	15.150	-92.248	0,00	0,00	0,00
BBVA RMBS 5 FTA	1.327.421	1.875	0	0	0	198.350	313	0	0	0	0,00	10,00	0,00
BBVA RMBS 9, FTA	400.162	565	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	13,50	0,00
BBVA-6 FTPYME FTA	0	0	0	0	0	12.615	16	0	44	-9.993	0,00	0,00	0,00
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	89.126	628	0	0	0	10.704	81	0	0	0	0,00	5,01	2,17
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	0	0	0	0	0	29.569	159	0	0	0	0,00	144,58	0,00
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	0	0	0	0	0	14.557	6	0	0	0	0,00	47,76	0,00
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	259.616	395	0	0	0	319.500	648	0	0	0	0,00	6,01	0,00
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	1.780.000	2.244	0	0	0	220.000	336	0	0	0	0,00	5,00	0,00
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	12.816	3	0	0	0	256.200	93	0	0	0	0,00	5,42	0,00
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	63.982	599	0	0	0	532.000	5.231	0	0	0	0,00	4,42	0,00
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	371.751	542	0	0	0	318.500	495	0	0	0	0,00	5,30	0,00
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	542.714	63	0	0	0	357.000	69	0	0	0	0,00	5,52	0,00
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACION	2.610.000	8.156	0	0	0	390.000	1.341	0	0	0	0,00	5,00	0,00
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	5.805.506	10.006	0	0	0	1.349.000	2.404	0	54.638	0	0,00	7,78	0,00

Información obligaciones y otros valores negociables

CUADRO A.1.3

Miles de euros

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				
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	1.268.330	12.009	0	0	0	272.000	2.662	0	1.996	0	0,00	6,17	0,00
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	1.087.188	1.608	0	0	0	255.000	390	0	2.239	0	0,00	4,14	0,00
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	61.359	247	0	0	0	5.392	26	0	0	0	0,00	18,00	0,00
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	1.120.000	591	0	0	0	107.700	60	0	0	0	0,00	1,14	0,00
CEDULAS TDA 6, FTA	3.000.000	70.512	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	2,86
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	414.000	184	0	0	0	152.000	73	0	0	0	0,00	0,00	0,00
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	0	0	0	0	0	1.012	13	0	0	0	0,00	476,77	0,00
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	49.356	465	0	0	0	64.000	893	0	12.798	-12.743	43,54	23,38	0,00
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	42.232	71	0	0	0	41.300	105	0	9.364	-9.508	50,56	22,49	0,00
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	4.208	194	11.527	0	-11.547	14.300	244	0	6.492	-21.036	0,00	0,00	0,00
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	118.082	1.015	0	0	0	171.100	1.685	0	5.055	-735	0,00	5,09	0,00
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	312.441	3.810	132.205	0	0	249.100	2.514	0	15.686	-153.290	0,00	0,00	0,00
FTA UCI 11	49.696	95	0	0	0	28.900	63	0	0	0	0,00	16,22	0,00
FTA UCI 14	127.962	174	0	0	0	72.500	106	0	0	0	0,00	5,79	0,00
FTA UCI 16	224.209	356	0	0	0	136.800	247	0	0	0	0,00	3,99	0,00
FTA, UCI 15	166.698	264	0	0	0	100.840	172	0	0	0	0,00	4,28	0,00
FTA, UCI 17	207.750	331	0	0	0	112.000	196	0	0	0	0,00	3,50	0,00
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	4.767.800	77.778	0	0	0	0	0	0	0	0	100,00	0,00	6,59
FTH UCI 12	81.712	157	0	0	0	32.800	69	0	0	0	0,00	9,04	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	434.358	3.781	0	0	0	750.000	6.878	0	4.251	-21.872	0,00	12,37	0,00
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	279.707	611	0	0	0	72.100	162	0	0	0	0,00	2,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	259.726	567	0	0	0	98.000	78	0	0	0	0,00	2,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO X	406.969	733	0	0	0	63.300	82	0	0	0	0,00	2,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2	75.293	79	0	0	0	110.600	596	0	0	0	0,00	6,99	0,00
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	393.105	501	0	0	-288	580	1	0	0	-581	0,00	1,10	0,00
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	334.945	603	0	0	0	63.400	83	0	0	0	0,00	2,00	0,00
FTPYME TDA CAM 4, FTA	0	0	0	0	0	62.898	32	0	21.210	-7.335	0,00	42,19	0,00
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	0	0	0	0	0	22.923	49	0	1.460	-2.095	0,00	28,23	0,00
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	0	0	0	0	0	2.675	171	9.925	2.057	-9.859	0,00	0,00	0,00
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	68.360	119	26.416	0	0	42.700	68	0	8.251	-35.881	0,00	0,00	0,00
HIPOCAT 10, FTA	0	0	0	0	0	173.486	2.032	0	35.789	-61.948	0,00	0,00	0,00
HIPOCAT 11, FTA	0	0	0	0	0	246.482	2.959	0	40.017	-120.815	0,00	0,00	0,00
HIPOCAT 9, FTA	0	0	0	0	0	113.699	1.173	0	3.918	-9.116	0,00	7,04	0,00
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	325.724	2.860	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	11,87	0,00
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	393.183	3.178	2.151	0	0	0	0	0	0	0	0,00	10,24	0,00

Miles de euros

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 ANDBANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	90.692	36	0	0	0	14.942	6	0	251	-244	0,00	6,71	0,00
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	200.235	248	0	0	0	135.000	73	0	0	0	0,00	6,71	0,00
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	372.259	0	0	0	0	94.300	5	0	0	0	0,00	3,11	0,00
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACION	178.204	181	0	0	0	230.000	239	0	0	0	0,00	7,35	0,00
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	342.331	347	0	0	0	198.000	331	0	0	0	0,00	5,00	0,00
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	108.609	65	0	0	0	63.125	256	0	0	0	0,00	5,55	0,00
IM BCG RMBS 2, FTA	449.783	468	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	8,67	0,00
IM CAJAMAR 3, FTA	123.080	125	0	0	0	9.980	11	0	0	0	0,00	6,54	0,00
IM CAJAMAR 4, FTA	130.972	132	0	0	0	16.926	24	0	0	0	0,00	4,06	0,00
IM CAJAMAR 5, FTA	134.890	139	0	0	0	18.596	28	0	0	0	0,00	4,89	0,00
IM CAJAMAR 6, FTA	329.211	347	0	0	0	68.549	335	0	0	0	0,00	6,37	0,00
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	105.932	135	0	0	0	70.621	96	0	0	0	0,00	27,00	0,00
IM PASTOR 2, FTH	0	0	0	0	0	31.513	40	0	0	0	0,00	15,87	0,00
IM PASTOR 3, FTH	62.199	63	0	0	0	39.000	-31	0	74	-13.385	0,00	0,00	0,00
IM PASTOR 4, FTA	80.649	82	0	0	0	34.000	38	0	2	0	0,00	0,00	0,00
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	119.760	566	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	20,81	0,00
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	121.689	575	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	20,54	0,00
MADRID RMBS I, FTA	172.274	769	0	0	0	200.000	960	0	0	0	0,00	3,50	0,00
MADRID RMBS II, FTA	142.785	642	0	0	0	180.000	869	0	0	0	0,00	3,55	0,00
MADRID RMBS III FTA	435.331	1.977	0	0	0	270.000	1.377	0	37.867	0	0,00	0,00	0,00
MADRID RMBS IV, FTA	323.720	1.502	0	0	0	213.600	1.129	0	0	0	0,00	15,18	0,00
MBS BANCAJA 3, FTA	0	0	0	0	0	74.573	48	0	0	0	0,00	13,41	0,00
MBS BANCAJA 4, FTA	0	0	0	0	0	223.594	2.002	0	0	0	0,00	10,33	0,00
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	595.000	228	0	0	0	255.000	101	0	0	0	0,00	0,84	0,00
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	1.249.778	18	0	0	-1.292	0	0	0	0	0	0,00	0,82	0,00
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	5.115.000	159.376	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	2,01
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACION	319.232	483	0	0	0	137.200	179	0	704	0	0,00	1,53	0,00
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	156.745	749	0	0	0	135.700	282	0	376	-9.670	0,00	0,00	0,00
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	2.380.784	12.035	0	0	0	945.000	5.351	0	9.066	0	0,00	5,45	0,00
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	3.575.961	16.862	0	0	0	795.000	4.160	0	29.454	-33.153	0,00	4,63	0,00
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	0	0	0	0	0	217.765	1.186	0	0	0	0,00	3,44	0,00
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	0	0	0	0	0	124.000	1.103	0	0	0	0,00	4,72	0,00
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	281.630	1.165	0	0	0	30.260	135	0	0	0	0,00	6,63	0,00
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	372.068	217	0	0	0	31.915	21	0	0	0	0,00	8,85	0,00
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	196.314	230	0	0	0	24.139	30	0	0	0	0,00	9,49	0,00

Miles de euros

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 XIV, FTA	42.737	249	0	0	0	22.500	137	0	0	0	0,00	16,90	0,00
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	230.610	1.198	0	0	0	42.500	228	0	104	0	0,00	6,66	0,00
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	131.498	722	0	0	0	52.900	304	0	0	0	0,00	14,53	0,00
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	27.804	253	0	0	0	16.500	157	0	0	0	0,00	17,38	0,00
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	17.729	207	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	81,54	0,00
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	118.711	292	0	0	0	21.700	55	0	0	0	0,00	8,17	0,00
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE TITULIZACION	552.300	6.880	0	0	0	107.200	2.382	0	0	0	0,00	1,44	0,00
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	82.841	49	0	0	0	21.947	27	0	0	-500	0,00	1,19	0,00
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	294.682	194	0	0	0	146.458	208	0	0	0	0,00	1,17	0,00
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	151.948	222	0	0	0	66.862	82	0	0	0	0,00	2,49	0,00
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	160.618	251	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	1,62	0,00
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	700.000	1.261	0	0	0	3.500	15	0	0	0	0,00	1,00	0,00
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	600.000	869	0	0	0	7.954	31	0	0	0	0,00	1,73	0,00
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	604.811	1.076	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	2,29	0,00
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	690.910	1.197	0	0	0	16.000	27	0	0	-3.442	0,00	2,26	0,00
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	13.487.000	4.881	0	0	0	2.263.000	948	0	25.445	0	0,00	0,76	0,00
TDA 19 - MIXTO, FTA	16.819	17	0	0	0	11.772	18	0	0	0	0,00	40,90	0,00
TDA 22 - MIXTO, FTA	9.656	3	0	0	0	32.141	14	0	0	0	0,00	6,89	0,00
TDA 24, FTA	40.060	41	0	0	0	26.600	30	0	3.202	-14.653	0,00	0,00	0,00
TDA 25, FTA	95.186	97	0	0	-48.028	14.700	17	0	2.499	-17.215	0,00	0,00	0,00
TDA 26 - MIXTO, FTA	59.976	423	0	0	0	19.142	182	0	0	0	0,00	9,26	0,00
TDA 27, FTA	121.857	42	0	0	0	51.800	20	0	7.355	-29.900	0,00	0,00	0,00
TDA 28, FTA	163.595	1.170	0	0	-37.860	37.350	333	0	8.277	-45.961	0,00	0,00	0,00
TDA 29, FTA	116.118	440	0	0	0	16.255	80	0	0	0	0,00	3,70	0,00
TDA 30, FTA	81.065	29	0	0	0	11.702	7	0	34	0	0,00	4,42	0,00
TDA CAJAMAR 2, FTA	69.146	31	0	0	0	8.031	4	0	0	0	0,00	6,80	4,01
TDA CAM 4, FTA	27.534	12	0	0	0	48.000	22	0	0	0	0,00	26,48	0,00
TDA CAM 5, FTA	165.423	1.232	0	0	0	56.000	441	0	0	0	0,00	4,97	0,00
TDA CAM 6, FTA	107.924	759	0	0	0	48.208	351	0	0	0	0,00	4,58	0,00
TDA CAM 7, FTA	156.726	607	0	0	0	92.700	373	0	0	0	0,00	4,39	0,00
TDA CAM 8, FTA	185.605	716	0	0	0	45.304	209	0	0	0	0,00	3,68	0,00
TDA CAM 9, FTA	161.874	1.153	0	0	0	91.500	784	0	8.936	0	0,00	3,70	0,00
TDA IBERCAJA 3, FTA	106.357	36	0	0	0	15.119	7	0	0	0	0,00	4,12	0,00
TDA IBERCAJA 4, FTA	160.436	621	0	0	0	29.436	145	0	0	0	0,00	3,69	0,00
TDA IBERCAJA 5, FTA	177.897	688	0	0	0	23.606	118	0	0	0	0,00	2,98	0,00

Información obligaciones y otros valores negociables

CUADRO A.1.3

Miles de euros

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 IBERCAJA 6, FTA	288.919	1.161	0	0	0	35.840	171	0	0	0	0,00	5,70	0,00
TDA IBERCAJA 7, FTA	560.973	2.255	0	0	0	106.398	525	0	0	0	0,00	6,54	0,00
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	42.083	171	0	0	0	18.850	146	1.909	1.350	-3.077	66,97	30,00	0,00
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	2.849.274	11.991	0	0	0	570.000	2.480	0	0	0	0,00	5,05	0,00
TDA TARRAGONA 1, FTA	41.545	20	0	0	0	15.963	11	0	0	0	0,00	12,78	0,00
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	0	0	0	0	0	104.488	123	0	70	0	0,00	4,98	0,00
Subtotal BONOS 31/12/2023	102.819.262	651.303	177.112	0	-99.015	25.735.504	107.682	11.834	448.071	-806.970	3,88	4,33	0,48
PAGARÉS													
Subtotal PAGARÉS 31/12/2023	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	-
PRIVADOS													
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE TITULIZACION	250	0	0	0	-200	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	11.800	5	0	0	-44	0	0	0	0	0	0,00	2,00	0,00
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	129.000	36	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	19.752	638	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACION	123.675	0	0	0	-8.453	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	213.673	180	0	0	0	0,00	19,48	0,00
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE TITULIZACION	134.407	764	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACION	35.000	1.003	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACION	30.500	660	0	0	-299	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACION	11.600	4	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	2,00	0,00
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	21.142	28	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	692	2	0	0	-172	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,96
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACION	26.450	3	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	979.367	640	0	0	-58.864	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	182.444	369	0	0	-2.481	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	128.862	249	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	7.401	29	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	21.738	326	0	0	-971	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	26.224	45	0	0	0	32.828	131	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	13.990	9	0	0	0	36.374	40	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	87.331	2.750	0	0	-2.660	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	12.189	27	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	498.122	4.701	0	0	-118.686	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FTA2015, FTA	656.726	16.916	0	1.867.712	-2.171.351	524.725	0	0	0	-524.725	0,00	0,00	33,71
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	267.242	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	10.713	180	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	33.752	215	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00

Información obligaciones y otros valores negociables

CUADRO A.1.3

Miles de euros

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				
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	21.591	149	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	1,00
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	65.173	2.299	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	97.098	2.486	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	17.615	17	0	0	-1.312	17.615	0	0	0	-6.457	0,00	0,95	0,00
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	371.956	2.900	0	0	-256	0	0	0	0	0	0,00	0,04	0,00
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	23.700	12	0	0	-150	0	0	0	0	0	0,00	0,21	0,00
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	27.878	526	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE TITULIZACION	12.900	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	98.620	1.836	0	0	-33	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	10.245	241	0	0	-102	0	0	0	0	0	0,00	0,40	0,00
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	32.300	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
PENSIUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	2.300	3	0	0	-142	0	0	0	0	0	0,00	1,00	0,00
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	13.436	7	0	0	0	4.817	4	0	0	-724	0,00	0,00	0,00
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	85.400	121	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	27.420	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
SLF, FONDO DE TITULIZACION	92.161	102	0	0	-14.250	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	70.763	299	0	778	-12.968	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	398.047	1.958	0	53.502	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	352.000	7	0	0	0	48.000	9	0	0	0	0,00	1,74	0,00
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	67.672	0	0	0	-2.375	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	93.474	0	0	0	-8.162	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	12.863	0	0	0	-403	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	98.313	0	0	0	-1.614	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	153.787	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	95.000	1.385	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE TITULIZACION	110.923	43	0	0	0	28.848	11	0	0	0	0,00	0,00	0,00
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	151.760	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	25.200	61	0	0	-7.994	0	0	0	0	0	0,00	1,04	0,00
Subtotal PRIVADOS 31/12/2023	6.099.964	44.051	0	1.921.992	-2.413.942	906.880	375	0	0	-531.906	0,00	0,86	2,16
Total 31/12/2023	108.919.226	695.354	177.112	1.921.992	-2.512.957	26.642.384	108.057	11.834	448.071	-1.338.876	3,71	4,18	0,55

(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 pasivos emitidos

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

Miles de euros

FONDO	MARGEN DE INTERESES		GASTOS DE EXPLOTACIÓN			DETERIORO	RTDO ACTIVOS NC EN VENTA (4)
	IMPORTE	% / TA (1)	IMPORTE	% / TA (2)	% COMISIONES (3)		
BONOS							
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	200	0,17	-413	-0,35	-0,29	-1.176	0
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	4.064	9,09	-4.726	-10,57	-10,41	-226	0
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	17.732	9,95	-19.072	-10,70	-10,65	-617	0
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	28.849	6,07	-26.106	-5,49	-5,47	-501	0
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	24.945	10,41	-23.472	-9,80	-9,76	-1.473	0
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	47.989	8,16	-45.141	-7,67	-7,66	-2.848	0
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	19.429	3,87	-16.274	-3,24	-3,22	-3.161	0
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	7.050	1,19	-7.012	-1,19	-1,09	-37	0
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	-1.661	-0,95	-141	-0,08	-0,06	0	0
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	-436	-0,85	-76	-0,15	-0,08	1.405	0
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	136	0,01	-140	-0,01	0,00	0	0
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	73	0,00	-75	0,00	0,00	0	0
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	11.585	1,12	-1.044	-0,10	-0,09	1.297	0
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	295	0,19	-115	-0,07	-0,05	187	0
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	91	0,14	-119	-0,18	-0,11	0	0
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	455	0,30	-154	-0,10	-0,05	75	31
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	418	0,19	-149	-0,07	-0,04	201	31
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	-106	-0,06	-139	-0,08	-0,05	172	-6
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	-1.337	-0,59	-116	-0,05	-0,03	912	9
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	-1.104	-0,62	-118	-0,07	-0,04	433	35
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	-2.906	-0,26	-491	-0,04	-0,03	2.384	-10
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	-783	-0,20	-197	-0,05	-0,03	1.320	-27
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	-1.433	-0,34	-179	-0,04	-0,03	894	14
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	696	0,45	-581	-0,37	-0,35	-84	0
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	2.478	1,39	-3.009	-1,69	-1,68	530	0
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	-257	-122,57	-67	-31,93	-18,24	0	0
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	124	0,16	-1.175	-1,50	-1,45	549	1
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	101	0,23	-77	-0,18	-0,05	-69	0
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	652	0,51	-849	-0,66	-0,63	197	0
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	1.016	0,38	-380	-0,14	-0,12	1.235	0
BANCAJA 10, FTA	1.048	0,20	-744	-0,14	-0,03	-6.385	663
BANCAJA 11, FTA	809	0,16	-664	-0,13	-0,03	-6.414	666
BANCAJA 13, FTA	-3.170	-0,27	-1.043	-0,09	-0,02	-3.428	943
BANCAJA 8, FTA	515	0,31	-229	-0,14	-0,05	-65	292
BANCAJA 9, FTA	-840	-0,30	-307	-0,11	-0,04	-1.489	179
BANKINTER 10, FTA	-14	-0,01	-104	-0,06	-0,04	0	42
BANKINTER 11, FTH	-58	-0,05	-88	-0,08	-0,06	0	21
BANKINTER 13 FTA	270	0,10	-127	-0,05	-0,03	116	103
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	8.241	6,37	-7.311	-5,65	-5,61	-930	0
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	32.333	5,35	-26.224	-4,34	-4,32	-6.109	0
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACION	31.698	3,79	-25.130	-3,00	-2,99	-6.573	0
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	8.944	1,21	-7.816	-1,06	-1,05	-1.128	0
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	42.722	7,59	-29.482	-5,24	-5,23	-13.240	0
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	69.732	7,54	-48.369	-5,23	-5,22	-21.363	0
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	75.313	2,85	-66.617	-2,52	-2,52	-8.696	0
BBVA LEASING 1, FTA	-3.884	-143,91	-101	-3,74	-2,26	552	0
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	5.361	0,21	-5.361	-0,21	-0,21	0	0
BBVA RMBS 1, FTA	2.177	0,39	-315	-0,06	-0,03	16	-284
BBVA RMBS 14, FTA	-3.630	-1,17	-187	-0,06	-0,04	0	0
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	13.085	1,34	-12.335	-1,26	-1,26	-750	0
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	6.057	0,42	-5.801	-0,40	-0,40	-256	0
BBVA RMBS 2, FTA	5.916	0,57	-845	-0,08	-0,03	-154	-716

Miles de euros

FONDO	MARGEN DE INTERESES		GASTOS DE EXPLOTACIÓN			DETERIORO	RTDO ACTIVOS NC EN VENTA (4)
	IMPORTE	% / TA (1)	IMPORTE	% / TA (2)	% COMISIONES (3)		
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	21.097	0,93	-20.542	-0,91	-0,90	-555	0
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	75.127	0,68	-71.664	-0,65	-0,65	-3.463	0
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	9.145	0,58	-9.107	-0,58	-0,58	-38	0
BBVA RMBS 3, FTA	103	0,01	-733	-0,08	-0,03	-73	-303
BBVA RMBS 5 FTA	-14.072	-0,83	-621	-0,04	-0,03	-4.431	-344
BBVA RMBS 9, FTA	3.182	0,53	-2.172	-0,36	-0,35	-1.705	-11
BBVA-6 FTPYME FTA	-1.764	-65,43	-204	-7,57	-1,97	-3.344	-1.203
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	983	0,87	-1.261	-1,12	-1,08	6	19
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	-408	-0,53	-75	-0,10	-0,07	5	108
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	29	0,11	-761	-2,81	-2,63	-22	0
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	43.833	7,08	-28.300	-4,57	-4,56	-15.533	0
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	22.358	1,06	-5.509	-0,26	-0,23	-16.849	0
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	9.792	3,44	-7.342	-2,58	-2,55	-2.449	0
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	-6.298	-1,00	-333	-0,05	-0,04	572	0
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	17.820	2,43	-13.899	-1,90	-1,89	-3.921	0
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	25.027	2,63	-19.392	-2,04	-2,03	-5.636	0
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACION	6.617	0,21	-5.742	-0,18	-0,16	-875	0
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	-75.918	-0,98	-1.630	-0,02	-0,02	-7.281	0
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	-17.385	-1,05	-612	-0,04	-0,03	-1.664	0
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	-9.386	-0,67	-561	-0,04	-0,04	-2.809	0
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	-978	-1,20	-117	-0,14	-0,10	0	0
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	41.954	3,34	-41.451	-3,30	-3,30	-503	0
CEDULAS TDA 6, FTA	71	0,00	-7	0,00	0,00	0	0
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	92.939	13,83	-90.082	-13,40	-13,39	-2.857	0
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	-682	-8,01	-68	-0,80	-0,40	-97	3
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	-221	-0,19	-145	-0,12	-0,09	1.574	0
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	-105	-0,12	-125	-0,15	-0,11	287	0
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	-1.360	-29,15	-141	-3,02	-2,02	549	52
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	2.131	0,71	-284	-0,09	-0,03	-613	-566
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	-880	-0,15	-563	-0,10	-0,03	-2.681	-1.122
FTA UCI 11	145	0,15	-1.484	-1,56	-1,52	85	235
FTA UCI 14	1.209	0,53	-2.618	-1,14	-1,13	1.480	-71
FTA UCI 16	2.274	0,59	-4.078	-1,05	-1,04	1.750	-933
FTA, UCI 15	1.666	0,59	-3.524	-1,24	-1,23	2.077	-219
FTA, UCI 17	1.833	0,54	-3.823	-1,13	-1,12	2.687	-728
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	25.411	0,36	-1.664	-0,02	-0,01	0	0
FTH UCI 12	-297	-0,23	-1.210	-0,94	-0,92	383	39
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	3.312	0,28	-958	-0,08	-0,07	-6.326	14
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	6.351	1,59	-5.485	-1,38	-1,36	-26	-210
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	1.322	0,36	-464	-0,13	-0,11	60	-217
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO X	6.089	1,22	-5.411	-1,09	-1,08	-107	-31
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2	11.111	5,79	-12.490	-6,51	-6,48	1.379	0
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	26.510	6,29	-24.604	-5,84	-5,82	-633	0
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	7.594	1,79	-5.651	-1,33	-1,31	-95	-570
FTPYME TDA CAM 4, FTA	-1.044	-1,36	-291	-0,38	-0,03	-18	-61
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	-492	-1,83	-87	-0,32	-0,17	81	0
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	-1.097	-21,27	-173	-3,35	-0,70	162	5
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	-1.430	-1,30	-717	-0,65	-0,09	2.810	814
HIPOCAT 10, FTA	-2.753	-1,83	-272	-0,18	-0,04	83	-293
HIPOCAT 11, FTA	-4.739	-2,81	-418	-0,25	-0,05	196	-708
HIPOCAT 9, FTA	-141	-0,13	-193	-0,18	-0,05	525	-231
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	-6.259	-1,18	-201	-0,04	-0,03	-692	0
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	-4.804	-0,86	-220	-0,04	-0,03	-469	0
IM ANDBANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	-213	-0,20	-238	-0,22	-0,11	0	0

Miles de euros

FONDO	MARGEN DE INTERESES		GASTOS DE EXPLOTACIÓN			DETERIORO	RTDO ACTIVOS NC EN VENTA (4)
	IMPORTE	% / TA (1)	IMPORTE	% / TA (2)	% COMISIONES (3)		
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	2.764	0,77	-2.739	-0,76	-0,75	-26	0
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	19.098	3,94	-19.075	-3,94	-3,93	-23	0
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACION	5.563	1,26	-6.023	-1,36	-1,34	460	0
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	17.084	2,99	-16.741	-2,93	-2,92	-343	0
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	7.221	3,85	-6.785	-3,62	-3,56	464	0
IM BCG RMBS 2, FTA	1.596	0,26	-1.596	-0,26	-0,25	0	0
IM CAJAMAR 3, FTA	1.366	0,93	-1.478	-1,01	-0,99	112	0
IM CAJAMAR 4, FTA	970	0,64	-970	-0,64	-0,62	0	0
IM CAJAMAR 5, FTA	-561	-0,36	-119	-0,08	-0,05	19	0
IM CAJAMAR 6, FTA	-2.003	-0,50	-152	-0,04	-0,03	24	0
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	-1.472	-0,64	-170	-0,07	-0,05	-6	0
IM PASTOR 2, FTH	-48	-0,12	-97	-0,24	-0,04	-48	62
IM PASTOR 3, FTH	-1.942	-2,10	-464	-0,50	-0,05	128	-64
IM PASTOR 4, FTA	-1.345	-1,12	-662	-0,55	-0,05	-174	-599
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	-1.168	-0,41	-470	-0,16	-0,04	-327	252
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	-397	-0,14	-400	-0,14	-0,04	-102	440
MADRID RMBS I, FTA	622	0,14	-1.075	-0,24	-0,03	-1.063	1.014
MADRID RMBS II, FTA	-813	-0,21	-944	-0,24	-0,03	-538	1.324
MADRID RMBS III FTA	-3.430	-0,42	-2.370	-0,29	-0,02	-1.821	1.498
MADRID RMBS IV, FTA	-13.005	-1,95	-1.742	-0,26	-0,04	-8.932	1.120
MBS BANCAJA 3, FTA	221	0,27	-101	-0,12	-0,05	-254	62
MBS BANCAJA 4, FTA	1.104	0,43	-298	-0,12	-0,03	-1.264	112
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	27.984	3,21	-13.151	-1,51	-1,49	-13.466	0
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	73.484	5,31	-73.820	-5,34	-5,32	-2.818	0
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	28	0,00	-10	0,00	0,00	0	0
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACION	-2.775	-0,60	-873	-0,19	-0,02	-467	0
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	877	0,44	-3.833	-1,91	-0,56	-6.714	0
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	-18.005	-0,54	-1.031	-0,03	-0,03	-2.600	-201
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	-27.960	-0,64	-1.323	-0,03	-0,03	-6.158	-97
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	1.458	0,63	-1.476	-0,64	-0,62	76	-29
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	716	0,54	-764	-0,58	-0,55	0	48
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	2.378	0,70	-2.025	-0,60	-0,56	0	-109
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	1.990	0,44	-1.977	-0,44	-0,43	0	-15
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	493	0,20	-398	-0,16	-0,14	0	-36
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	-443	-0,56	-78	-0,10	-0,04	0	0
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	398	0,14	-390	-0,13	-0,11	-8	0
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	-827	-0,38	-105	-0,05	-0,03	0	0
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	-283	-0,53	-63	-0,12	-0,05	0	0
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	-488	-1,11	-73	-0,17	-0,05	0	0
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	269	0,18	-230	-0,15	-0,11	0	0
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE TITULIZACION	6.352	0,94	-532	-0,08	-0,05	-2	0
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	7.009	6,51	-171	-0,16	-0,09	-3.314	0
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	13.591	2,97	-4.117	-0,90	-0,88	-10.090	0
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	20.525	8,91	-20.538	-8,92	-8,89	13	0
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	11.377	6,62	-11.132	-6,48	-6,43	-245	0
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	23.590	3,19	-20.344	-2,75	-2,75	-3.067	0
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	4.206	0,69	-1.906	-0,31	-0,03	-4.739	0
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	45.334	6,97	-34.458	-5,30	-5,29	-10.876	0
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	4.877	0,69	-2.113	-0,30	-0,01	-8.251	0
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	19.976	0,12	-510	0,00	0,00	-12	0
TDA 19 - MIXTO, FTA	-339	-0,82	-607	-1,48	-1,47	0	0
TDA 22 - MIXTO, FTA	-482	-0,95	-404	-0,80	-0,24	-41	-175
TDA 24, FTA	-1.360	-2,40	-754	-1,33	-0,27	-20	-144
TDA 25, FTA	-3.240	-6,55	-1.302	-2,63	-0,14	-14.545	-305

Miles de euros

FONDO	MARGEN DE INTERESES		GASTOS DE EXPLOTACIÓN			RTDO ACTIVOS NC EN VENTA (4)	
	IMPORTE	% / TA (1)	IMPORTE	% / TA (2)	% COMISIONES (3)	DETERIORO	
TDA 26 - MIXTO, FTA	425	0,50	-1.186	-1,39	-1,35	0	0
TDA 27, FTA	-1.810	-1,13	-1.016	-0,63	-0,05	-717	-155
TDA 28, FTA	-3.592	-2,73	-1.822	-1,38	-0,07	-1.144	-52
TDA 29, FTA	1.005	0,72	-1.372	-0,98	-0,96	0	0
TDA 30, FTA	699	0,72	-518	-0,53	-0,49	0	0
TDA CAJAMAR 2, FTA	952	1,07	-5.463	-6,15	-6,10	0	0
TDA CAM 4, FTA	825	0,76	-2.779	-2,57	-2,43	0	-5
TDA CAM 5, FTA	2.397	0,90	-4.714	-1,77	-1,44	-203	-24
TDA CAM 6, FTA	1.437	0,73	-975	-0,49	-0,04	16	-12
TDA CAM 7, FTA	2.466	0,82	-3.170	-1,05	-0,73	-128	-24
TDA CAM 8, FTA	2.103	0,78	-1.542	-0,57	-0,20	-251	66
TDA CAM 9, FTA	1.727	0,59	-1.243	-0,43	-0,03	-639	-208
TDA IBERCAJA 3, FTA	767	0,63	-1.270	-1,04	-1,01	144	0
TDA IBERCAJA 4, FTA	1.114	0,58	-2.735	-1,42	-1,41	286	0
TDA IBERCAJA 5, FTA	-177	-0,09	-2.538	-1,24	-1,22	378	0
TDA IBERCAJA 6, FTA	1.427	0,41	-1.397	-0,40	-0,39	507	0
TDA IBERCAJA 7, FTA	2.255	0,33	-2.837	-0,42	-0,41	153	0
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	-501	-0,81	-111	-0,18	-0,13	0	0
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	24.814	0,68	-602	-0,02	-0,01	-317	0
TDA TARRAGONA 1, FTA	223	0,35	-438	-0,68	-0,62	1	0
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	240	0,22	-288	-0,26	-0,19	0	45
Subtotal BONOS 2023	1.046.225	0,74	-1.093.516	-0,78	-0,75	-246.685	-758
Subtotal BONOS 2022	1.502.412	1,02	-1.398.039	-0,95	-0,93	-127.747	68.666
%Variación	-30,36	-27,00	-21,78	-18,00	-19,20	93,10	-101,10
PAGARES							
Subtotal PAGARÉS 2023	0	0,00	0	0,00	0,00	0	0
Subtotal PAGARÉS 2022	0	0,00	0	0,00	0,00	0	0
%Variación	-	-	-	-	-	-	-
PRIVADOS							
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE TITULIZACION	0	0,22	-931	-454,08	-75,98	0	0
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	1.590	13,50	-2.263	-19,21	-17,90	-251	0
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	978	0,64	-1.017	-0,66	-0,58	39	0
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	0	0,00	0	0,00	0,00	0	0
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACION	1.140	0,99	-214	-0,19	-0,12	282	0
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	4.080	1,57	-4.080	-1,57	-1,56	0	0
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE TITULIZACION	496	0,36	-496	-0,36	-0,23	0	0
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACION	0	0,00	0	0,00	0,00	0	0
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACION	210	0,67	-215	-0,69	-0,65	0	0
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACION	1.939	16,16	-1.809	-15,08	-13,83	0	0
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	264	1,23	-247	-1,15	-0,95	0	0
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	-3	-0,63	-41	-7,70	-6,16	-89	0
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACION	18.690	33,43	-20.201	-36,13	-36,11	0	0
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	-32.958	-2,88	-41.022	-3,58	-0,02	0	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	-2.481	-0,99	-1.197	-0,48	-0,45	0	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	1.822	1,11	-2.999	-1,82	-1,21	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	-61	-0,77	-168	-2,12	-1,37	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	41	0,17	-190	-0,80	-0,60	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	-565	-0,89	-304	-0,48	-0,37	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	-253	-0,47	-317	-0,58	-0,49	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	-3.922	-4,06	-513	-0,53	-0,48	0	0
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	0	0,00	-168	-1,19	-0,01	0	0
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	-145	-0,03	-234	-0,04	-0,02	47.044	-88
FTA2015, FTA	-253.550	-67,03	-14.053	-3,72	-2,16	-21.911	0
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	1.304	3,18	-1.058	-2,58	-2,52	-246	0

Miles de euros

FONDO	MARGEN DE INTERESES		GASTOS DE EXPLOTACIÓN			DETERIORO	RTDO ACTIVOS NC EN VENTA (4)
	IMPORTE	% / TA (1)	IMPORTE	% / TA (2)	% COMISIONES (3)		
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	1.319	11,00	-1.319	-11,00	-10,19	0	0
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	3.486	9,71	-3.486	-9,71	-9,28	0	0
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	2.682	11,19	-813	-3,39	-3,20	-1.869	0
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	653	0,97	-653	-0,97	-0,95	0	0
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	3.515	3,48	-3.515	-3,48	-3,41	0	0
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	-126	-0,53	-816	-3,41	-2,38	-7.273	0
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	889	0,24	-1.073	-0,29	-0,28	0	0
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	116	0,49	-116	-0,49	-0,46	0	0
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	1.021	3,48	-1.021	-3,48	-3,33	0	0
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE TITULIZACION	3.509	24,09	-1.997	-13,71	-13,38	0	0
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	215	0,21	-215	-0,21	-0,08	0	0
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	1.058	10,04	-858	-8,15	-5,46	-116	0
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	1.519	3,05	-345	-0,69	-0,08	0	0
PENSUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	108	4,90	-166	-7,57	-3,35	0	0
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	328	1,81	-634	-3,50	-3,33	-536	0
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	8.365	4,53	-8.365	-4,53	-4,52	0	0
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	2.475	8,48	-700	-2,40	-1,98	-38	0
SLF, FONDO DE TITULIZACION	9.394	11,41	-2.116	-2,57	-1,84	-4.547	0
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	4.620	7,84	-256	-0,43	-0,27	11.841	0
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	315	0,07	-213	-0,05	-0,05	0	0
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	9.591	2,36	-10.562	-2,59	-2,58	0	0
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	-382	-0,58	-378	-0,58	-0,41	-74	0
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	1.956	2,29	-471	-0,55	-0,18	337	0
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	0	0,00	-69	-0,55	-0,44	0	0
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	5.511	5,68	-2.982	-3,07	-1,64	123	0
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	19.184	12,34	-8.425	-5,42	-3,10	1.432	0
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	4.193	4,23	-4.147	-4,18	-4,16	0	0
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE TITULIZACION	5.555	3,91	-5.409	-3,80	-3,59	-146	0
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	49.618	18,01	-17.707	-6,43	-4,57	1.256	0
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	504	2,90	-427	-2,45	-1,72	-2.430	0
Subtotal PRIVADOS 2023	-120.195	-1,79	-172.988	-2,57	-1,63	22.828	-88
Subtotal PRIVADOS 2022	-96.654	-1,49	-92.050	-1,41	-1,10	-209.984	0
%Variación	24,36	20,39	87,93	81,94	47,97	-110,87	-
Total 2023	926.030	0,63	-1.266.504	-0,86	-0,79	-223.857	-846
Total 2022	1.405.758	0,91	-1.490.089	-0,97	-0,93	-337.731	68.666
%Variación	-34,13	-31,18	-15,00	-11,21	-15,53	-33,72	-101,23

(1) Porcentaje que representa el margen de intereses sobre el total activo a la fecha de cierre actual (31 de diciembre para el comparativo)

(2) Porcentaje que representan los gastos de explotación sobre el total activo a la fecha de cierre actual (31 de diciembre para el comparativo)

(3) Porcentaje que representa el importe del gasto por comisiones sobre el total activo a la fecha de cierre actual (31 de diciembre para el comparativo)

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

Miles de euros

FONDO	% VARIACIÓN MI (1)	INT ACTIVOS TITULIZADOS	INT OBLIGACIONES	OTROS INTERESES	TIPO INT DCHOS CREDITO (2)	TIPO INTERÉS OBLIGACIONES (3)
BONOS						
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	11.645	-12.027	582	7,31	0,58
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	-62,85	5.266	-1.739	-117	8,34	2,38
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-49,64	21.317	-9.685	634	9,43	3,19
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	77,13	41.245	-25.328	961	7,08	2,24
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	-29,65	25.369	-11.638	810	7,99	4,13
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	-25,47	47.575	-25.098	1.350	7,35	4,01
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	138,46	40.472	-27.662	673	7,55	4,92
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	-	13.637	-8.023	25	7,54	5,18
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	-137,24	4.099	-5.949	190	2,29	4,26
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	-	1.965	-2.120	-381	3,62	4,21
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	-31,79	128.361	-128.225	0	4,76	0,00
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	-1,47	75.643	-74.896	-674	3,75	3,75
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	0,00	31.205	-16.885	-3.607	2,84	1,73
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	0,00	4.785	-5.524	-19	2,80	3,90
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	0,00	1.772	-2.258	-51	2,53	3,89
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	0,00	4.689	-5.460	102	2,74	4,01
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	0,00	6.597	-7.907	4	2,68	4,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	46,62	5.013	-6.302	-490	2,58	4,08
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	-22,06	6.588	-7.727	-1.861	2,78	4,04
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	-261,79	4.672	-5.921	-1.276	2,66	4,19
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	0,00	32.185	-42.261	-4.646	2,67	4,20
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	0,00	10.280	-13.544	-1.567	2,65	3,79
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	-192,25	12.027	-14.859	-1.738	2,87	3,80
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	3,24	4.222	-5.101	-137	2,73	3,93
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	150,77	6.052	-6.399	173	2,66	3,92
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	-435,13	0	-237	-20	0,00	0,09
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	-86,27	2.376	-2.798	-193	2,78	4,10
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	-1,59	1.416	-1.542	-35	3,28	4,23
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	-7,29	4.165	-4.342	-258	3,02	3,88
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	393,45	9.550	-9.052	-548	3,26	3,86
BANCAJA 10, FTA	-19,57	17.365	-20.369	360	3,29	3,65
BANCAJA 11, FTA	-4,71	15.856	-19.265	96	3,20	3,69
BANCAJA 13, FTA	0,00	32.941	-38.426	-8.563	3,17	3,64
BANCAJA 8, FTA	498,84	5.478	-6.555	718	3,64	3,81
BANCAJA 9, FTA	-84,62	8.929	-12.025	747	3,45	3,88
BANKINTER 10, FTA	97,34	5.283	-6.952	485	2,99	3,54
BANKINTER 11, FTH	86,19	3.322	-4.379	256	2,97	3,56
BANKINTER 13 FTA	0,00	7.911	-9.723	528	3,07	3,50
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	-47,81	10.464	-2.175	-48	6,89	1,31
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-35,55	42.447	-30.636	1.339	6,65	4,45
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACION	43,44	56.305	-41.548	1.594	6,30	4,34
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	-	29.217	-22.535	535	6,69	5,00
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	-36,88	49.330	-6.583	-25	7,02	0,87
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	-32,22	71.798	-951	-1.115	6,84	0,09
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	-	122.630	-46.199	-1.118	5,68	2,05
BBVA LEASING 1, FTA	-157,90	245	-1.407	-2.590	3,49	3,95
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	-	12.066	-4.416	39	5,34	2,07
BBVA RMBS 1, FTA	-19,85	19.199	-19.160	-1.024	3,43	3,32
BBVA RMBS 14, FTA	0,00	7.023	-10.725	72	2,37	3,51
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	-15,36	45.893	-26.408	-6.400	4,83	3,42
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	-7,68	48.654	-44.889	-5.622	3,51	3,64
BBVA RMBS 2, FTA	-5,31	36.656	-35.996	38	3,50	3,33
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	-9,25	51.148	-69.280	976	2,51	3,30
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	20,99	386.651	-364.261	7.724	3,63	3,31
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	1.027,62	24.206	-45.769	571	1,82	3,35
BBVA RMBS 3, FTA	-98,11	36.541	-38.042	-1.813	3,83	3,46
BBVA RMBS 5 FTA	-78,71	62.637	-57.209	-19.500	3,88	3,45
BBVA RMBS 9, FTA	31,54	22.454	-14.903	-4.369	3,96	3,38
BBVA-6 FTPYME FTA	-142,64	88	-490	-1.362	4,34	3,78
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	-23,08	3.266	-3.644	32	3,22	3,48
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	0,00	1.082	-1.613	-276	3,42	4,96
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	-89,03	571	-693	-35	3,43	4,07
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	-52,04	53.134	-6.895	-2.407	7,22	0,89
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	-	72.507	-46.668	-3.481	6,86	4,22
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	108,80	14.103	-3.327	-985	4,42	0,99
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	0,00	24.694	-31.208	216	4,46	5,18
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	84,09	26.575	-6.544	-2.210	3,86	0,77
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	66,67	32.391	-4.184	-3.179	3,41	0,38

Miles de euros

FONDO	% VARIACIÓN MI (1)	INT ACTIVOS TITULIZADOS	INT OBLIGACIONES	OTROS INTERESES	TIPO INT DCHOS CREDITO (2)	TIPO INTERÉS OBLIGACIONES	
						(3)	
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	16.421	-9.497	-307	4,16		2,53
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	-	235.510	-287.185	-24.243	4,39		4,46
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	0,00	47.670	-60.360	-4.695	3,79		4,51
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	0,00	46.020	-53.183	-2.223	4,21		4,47
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	-161,55	1.773	-2.638	-112	2,59		3,62
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	172,82	88.058	-47.519	1.415	7,53		3,82
CEDULAS TDA 6, FTA	214,82	116.057	-116.057	71	3,88		3,88
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	-14,59	107.574	-12.780	-1.855	20,04		2,23
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	-164,34	45	-66	-686	4,05		5,61
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	19,49	3.162	-5.192	915	4,33		5,19
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	56,21	2.371	-4.176	656	4,34		5,40
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	-373,87	330	-1.934	-12	2,29		6,09
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	34,11	7.529	-11.286	546	4,38		4,40
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	0,00	15.349	-25.939	404	4,29		4,26
FTA UCI 11	-86,97	3.190	-3.101	56	4,46		4,25
FTA UCI 14	-70,42	8.666	-7.504	47	4,20		4,19
FTA UCI 16	-69,58	15.438	-13.949	785	4,37		4,29
FTA, UCI 15	-66,88	11.077	-10.025	614	4,41		4,18
FTA, UCI 17	-66,73	13.637	-12.226	663	4,45		4,23
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	-54,87	197.419	-127.795	-44.213	2,01		2,16
FTH UCI 12	0,00	4.066	-4.401	38	4,43		4,17
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	-90,38	45.447	-52.345	10.210	4,71		4,43
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	-16,81	13.007	-15.056	235	4,32		4,65
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	-81,07	12.856	-12.838	767	3,18		4,01
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO X	32,60	15.707	-19.093	360	3,11		4,65
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2	-47,30	17.479	-6.368	0	7,96		3,11
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	-15,52	30.917	-18.997	1.317	6,47		4,59
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	-12,77	12.878	-16.069	1.173	2,84		4,65
FTPYME TDA CAM 4, FTA	-42,69	1.177	-3.624	789	3,23		5,36
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	23,24	453	-1.501	199	2,31		5,24
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	-184,09	144	-711	-606	3,42		2,35
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	-1.298,71	2.874	-5.415	79	2,56		4,45
HIPOCAT 10, FTA	-209,33	4.660	-9.376	126	3,08		4,05
HIPOCAT 11, FTA	-425,97	5.328	-11.996	108	3,19		3,87
HIPOCAT 9, FTA	-13,71	3.239	-4.855	357	3,15		3,94
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	-549,50	14.328	-12.857	-7.729	2,41		3,99
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	-1.122,20	15.764	-15.398	-5.170	2,55		4,02
IM ANDBANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	3.936	-4.543	394	3,10		3,37
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	-31,90	14.181	-12.258	841	4,10		3,36
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	126,32	18.610	-191	679	3,84		0,04
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	-57,21	21.109	-16.596	1.050	4,61		3,38
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	37,81	21.432	-5.294	945	3,64		0,88
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	84,81	8.539	-2.047	730	4,59		0,91
IM BCG RMBS 2, FTA	121,46	21.535	-17.000	-2.939	3,71		3,45
IM CAJAMAR 3, FTA	36,21	4.725	-4.933	505	3,42		3,31
IM CAJAMAR 4, FTA	11,26	4.992	-5.690	434	3,35		3,43
IM CAJAMAR 5, FTA	0,00	5.064	-6.042	417	3,36		3,54
IM CAJAMAR 6, FTA	-218,45	12.824	-15.981	1.154	3,38		3,67
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	0,00	5.847	-6.851	-1.300	3,14		3,54
IM PASTOR 2, FTH	0,00	908	-1.539	42	2,83		4,12
IM PASTOR 3, FTH	-1.189,76	1.870	-3.705	-440	3,24		3,37
IM PASTOR 4, FTA	0,00	2.532	-4.282	-235	3,10		3,41
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	0,00	10.219	-4.608	-7.058	3,87		3,65
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	0,00	9.822	-4.744	-5.937	3,84		3,65
MADRID RMBS I, FTA	-63,23	17.141	-14.387	-2.565	4,16		3,55
MADRID RMBS II, FTA	0,00	14.898	-12.596	-2.727	4,14		3,58
MADRID RMBS III, FTA	0,00	29.791	-27.702	-5.923	3,87		3,65
MADRID RMBS IV, FTA	-181,09	22.422	-21.593	-13.891	3,91		3,79
MBS BANCAJA 3, FTA	53,47	2.487	-3.229	471	3,37		3,81
MBS BANCAJA 4, FTA	113,54	7.591	-9.086	969	3,39		3,71
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	-47,02	54.901	-28.045	1.128	7,41		3,53
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	-0,01	55.185	-718	19.017	3,20		0,05
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	0,00	217.073	-217.073	28	4,25		4,25
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACION	-	11.691	-14.596	130	3,25		4,34
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	-	14.823	-13.966	21	4,04		4,91
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	0,00	104.610	-122.615	0	4,18		4,18
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	0,00	127.094	-155.025	-29	4,31		4,12
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	1,46	7.559	-8.386	454	3,35		3,50
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	30,90	4.292	-4.729	315	3,42		3,48
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	128,65	11.040	-11.930	113	3,33		3,46

Miles de euros

FONDO	% VARIACIÓN MI (1)	INT ACTIVOS TITULIZADOS	INT OBLIGACIONES	OTROS INTERESES	TIPO INT DCHOS CREDITO (2)	TIPO INTERÉS
						OBLIGACIONES (3)
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	14,11	14.740	-15.762	11	3,40	3,50
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	0,82	8.711	-8.404	-649	3,70	3,44
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	0,00	2.380	-2.516	-307	3,42	3,50
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	-85,19	11.834	-11.064	-372	4,05	3,61
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	0,00	6.937	-7.071	-693	3,55	3,49
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	0,00	1.634	-1.707	-210	3,49	3,49
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	-114,98	1.241	-950	-779	4,06	4,59
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	-73,78	6.262	-5.723	-270	4,11	3,60
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE TITULIZACION	-	14.468	-9.263	525	7,22	5,44
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	-49,29	9.123	-7.094	475	6,72	4,29
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	58,77	37.480	-32.266	699	7,03	5,78
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	-37,57	21.874	-10.213	0	7,82	4,18
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-37,03	13.815	-8.137	574	6,86	4,67
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	307,36	45.997	-33.299	-84	6,79	5,43
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	-	10.562	-7.015	51	8,06	5,14
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	-37,37	52.503	-31.686	959	6,88	4,57
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	-	22.456	-20.677	829	6,63	5,66
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	-77,20	531.627	-590.822	-4.002	3,36	3,83
TDA 19 - MIXTO, FTA	-125,08	1.113	-1.356	-148	3,51	4,21
TDA 22 - MIXTO, FTA	-31,23	1.491	-1.927	-79	3,44	4,27
TDA 24, FTA	1,38	1.231	-2.555	69	3,88	3,64
TDA 25, FTA	0,00	634	-3.886	12	0,00	3,51
TDA 26 - MIXTO, FTA	197,94	2.597	-3.120	348	3,32	3,77
TDA 27, FTA	0,00	5.298	-6.704	-404	3,75	3,68
TDA 28, FTA	0,00	3.832	-7.325	-99	4,11	3,73
TDA 29, FTA	86,59	4.651	-5.068	311	3,34	3,62
TDA 30, FTA	65,66	3.459	-3.719	233	3,46	3,80
TDA CAJAMAR 2, FTA	0,00	3.479	-3.035	410	3,86	3,52
TDA CAM 4, FTA	30,31	2.700	-3.054	35	3,14	3,43
TDA CAM 5, FTA	45,05	7.001	-8.112	263	3,12	3,51
TDA CAM 6, FTA	34,58	5.015	-5.617	1	3,18	3,49
TDA CAM 7, FTA	24,47	7.890	-9.075	234	3,09	3,46
TDA CAM 8, FTA	38,90	7.267	-8.694	418	3,15	3,54
TDA CAM 9, FTA	25,79	8.000	-9.823	337	3,29	3,79
TDA IBERCAJA 3, FTA	37,85	4.711	-4.727	339	3,73	3,54
TDA IBERCAJA 4, FTA	56,83	7.188	-7.292	494	3,67	3,56
TDA IBERCAJA 5, FTA	0,00	7.651	-7.603	457	3,68	3,53
TDA IBERCAJA 6, FTA	87,27	12.813	-12.605	132	3,73	3,66
TDA IBERCAJA 7, FTA	54,73	23.697	-26.113	1.646	3,61	3,72
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	-52,22	1.009	-3.154	643	2,25	4,47
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	9,50	106.658	-135.176	4.099	3,06	3,79
TDA TARRAGONA 1, FTA	81,50	1.877	-2.562	315	3,51	4,19
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	-68,13	3.447	-4.069	4	3,10	3,41
Subtotal BONOS 2023	-30,36	5.081.963	-4.491.893	-138.211	4,14	3,51
Subtotal BONOS 2022	-13,31	3.012.374	-1.428.653	-86.316	2,36	1,53
%Variación	-128,15	68,70	214,41	60,12	75,31	129,17
PAGARÉS						
Subtotal PAGARÉS 2023	0,00	0	0	0	0,00	0,00
Subtotal PAGARÉS 2022	0,00	0	0	0	0,00	0,00
%Variación	-	-	-	-	-	-
PRIVADOS						
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE TITULIZACION	-	0	0	0	0,00	0,00
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	-3,51	2.410	-820	0	39,65	7,84
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	365,00	3.111	-2.182	49	3,18	1,95
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	-	1.081	-1.081	0	4,73	4,73
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACION	0,00	62.869	-61.740	11	0,00	0,00
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	10.453	-1.570	-4.803	4,94	0,30
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE TITULIZACION	-	1.188	-1.139	447	0,01	3,71
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACION	-	796	-1.772	0	0,00	0,00
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACION	74,05	1.730	-1.521	0	7,44	5,59
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACION	1.206,93	2.452	-512	-1	63,87	6,84
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	-69,02	590	-326	0	3,49	1,98
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	-101,37	52	-38	-17	6,46	5,50
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACION	137,31	19.363	-673	0	0,00	2,00
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	-	0	-39.638	6.515	0,00	6,82
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	0,00	0	-29.596	27.115	0,00	14,57

Miles de euros

FONDO	% VARIACIÓN MI (1)	INT ACTIVOS TITULIZADOS	INT OBLIGACIONES	OTROS INTERESES	TIPO INT DCHOS CREDITO (2)	TIPO INTERÉS OBLIGACIONES (3)
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	-	0	-5.221	7.043	0,00	13,96
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	0,00	0	-1.284	1.223	0,00	14,32
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	0,00	0	-3.443	3.484	0,00	12,85
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	0,00	0	-6.832	6.267	0,00	8,90
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	0,00	0	-5.897	5.644	0,00	8,71
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	0,00	0	-12.436	8.514	0,00	12,46
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	-	555	-555	0	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	0,00	14.983	-15.016	-112	4,86	0,00
FTA2015, FTA	-12,74	45.748	-299.216	-81	1,45	0,00
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	-	2.942	-148	-1.490	0,00	0,00
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	177,43	1.884	-633	67	2,06	0,00
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	107,28	4.060	-932	357	0,00	0,00
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	38,24	3.471	-789	0	4,06	2,00
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	7,08	3.574	-2.965	44	4,38	3,53
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	173,50	5.065	-3.836	2.286	0,01	2,55
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	0,00	2.109	-2.236	0	4,90	5,82
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	-32,64	11.553	-10.664	0	3,04	3,15
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	-2,06	653	-536	0	2,71	3,15
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	225,61	1.888	-951	83	0,02	3,61
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE TITULIZACION	-	3.694	-246	61	0,00	0,00
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	0,00	4.459	-4.244	0	4,27	3,34
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	-	1.559	-501	0	0,00	8,09
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	-	1.626	0	-107	6,05	0,00
PENSUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	-	162	-54	0	6,43	4,75
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	29,67	1.147	-853	5	7,10	2,56
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	28,14	11.339	-2.974	0	0,00	3,25
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	-	2.645	-198	27	0,00	0,00
SLF, FONDO DE TITULIZACION	44,52	17.884	-8.365	-125	5,20	0,00
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	-44,86	10.665	-6.044	0	3,01	0,00
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	0,00	38.077	-37.755	-7	7,08	0,00
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	-12,25	11.799	-1.960	-248	3,16	0,00
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	61.174	-61.603	47	0,00	0,00
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	0,00	57.116	-55.160	0	0,00	0,00
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	95,22	0	0	0	0,00	0,00
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	534,07	6.293	-854	72	0,00	0,00
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	95,96	22.492	-3.381	73	0,00	0,00
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	-	7.706	-4.383	870	0,00	0,00
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE TITULIZACION	-	10.156	-4.758	156	11,37	5,26
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	-8,01	49.618	0	0	3,83	0,00
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	-31,79	1.842	-1.338	0	10,82	4,40
Subtotal PRIVADOS 2023	24,36	526.034	-710.869	63.468	3,12	1,61
Subtotal PRIVADOS 2022	1,00	252.290	-390.663	42.634	2,04	1,21
%Variación	-	108,50	81,96	48,87	53,04	32,74
Total 2023	-34,13	5.607.997	-5.202.762	-74.743	4,10	3,44
Total 2022	-13,98	3.264.664	-1.819.316	-43.682	2,10	0,67
%Variación	-144,09	71,78	185,97	71,11	95,29	413,21

(1) Porcentaje de variación del margen de intereses con respecto al mismo periodo comparativo del año anterior.

(2) Tipo de interés medio ponderado de los activos titulizados a la fecha de cierre actual (31 de diciembre para el comparativo).

(3) Tipo de interés interanual medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos a la fecha de cierre actual (31 de diciembre para el comparativo).

Miles de euros

FONDO	COMISIÓN VARIABLE				
	COMISIÓN GESTORA DEVENGADA EN EL PERIODO	IMPORTE DEVENGADO EN EL PERIODO	IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR (1)	CORRECCIONES DE VALOR POR REPERCUSIÓN DE PÉRDIDAS (1)	OTRAS COMISIONES DEVENGADAS EN EL PERIODO
BONOS					
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	-74	0	0	0	-269
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	-115	-4.173	0	0	-366
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-113	-18.518	0	0	-357
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	-106	-25.162	0	0	-762
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	-85	-22.143	0	0	-1.146
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	-100	-43.872	3.784	0	-1.082
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	-100	-15.212	6.186	0	-876
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	-30	-6.158	6.158	0	-240
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	-20	0	6	-56	-93
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	-23	0	634	-766	-16
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	0	0	1	-1	0
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	0	0	1.538	-15	0
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	-159	-627	3.624	-5.385	-155
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	-43	0	983	-1.047	-37
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	-44	0	225	-286	-30
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	-44	0	1.130	-903	-36
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	-47	0	1.638	-1.697	-44
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	-43	0	2.101	-2.920	-39
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	-48	0	447	-1.480	-27
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	-42	0	0	0	-37
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	-238	0	1.462	-1.023	-141
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	-79	0	0	0	-46
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	-85	0	0	0	-50
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	-41	-492	320	0	-14
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	-46	-2.922	1.033	0	-18
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	-21	0	2.391	-2.509	-17
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	-42	-1.076	0	-90	-19
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	-19	0	334	-398	-4
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	-42	-740	968	0	-23
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	-55	-244	0	-5	-38
BANCAJA 10, FTA	-114	0	25.028	-26.957	-63
BANCAJA 11, FTA	-87	0	11.510	-13.119	-60
BANCAJA 13, FTA	-170	0	24.378	-26.800	-110
BANCAJA 8, FTA	-70	0	13.794	-4.027	-20
BANCAJA 9, FTA	-83	0	18.207	-19.338	-32
BANKINTER 10, FTA	-42	0	3.583	-2.523	-27
BANKINTER 11, FTH	-43	0	2.324	-2.372	-20
BANKINTER 13 FTA	-48	0	6.517	-2.783	-35
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	-84	-7.106	2.141	0	-64
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-136	-25.876	8.944	0	-114
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACION	-160	-24.753	8.523	0	-140
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	-82	-7.627	4.649	0	-70
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	-144	-29.133	1.449	0	-125
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	-177	-47.970	8.534	0	-158
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	-214	-66.091	19.430	0	-267
BBVA LEASING 1, FTA	-41	0	0	0	-20
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	-31	-5.296	5.296	0	-28
BBVA RMBS 1, FTA	-88	0	15.149	-13.030	-67
BBVA RMBS 14, FTA	-46	0	832	-872	-78
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	-135	-11.997	5.118	0	-145
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	-211	-5.337	2.290	0	-189
BBVA RMBS 2, FTA	-163	0	36.058	-5.905	-119
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	-248	-19.972	4.137	0	-254
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	-346	-70.118	14.645	0	-1.123

Miles de euros

FONDO	COMISIÓN GESTORA DEVENGADA EN EL PERIODO	COMISIÓN VARIABLE			OTRAS COMISIONES DEVENGADAS EN EL PERIODO
		IMPORTE DEVENGADO EN EL PERIODO	IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR (1)	CORRECCIONES DE VALOR POR REPERCUSIÓN DE PÉRDIDAS (1)	
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	-204	-8.653	2.084	0	-184
BBVA RMBS 3, FTA	-165	0	20.314	-20.314	-108
BBVA RMBS 5 FTA	-217	0	7.025	-9.594	-211
BBVA RMBS 9, FTA	-83	-1.907	4.399	-706	-105
BBVA-6 FTPYME FTA	-41	0	0	0	-12
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	-63	-1.145	0	0	-9
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	-46	0	0	0	-9
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	-48	-657	0	0	-9
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	-223	-27.922	3.790	0	-88
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	-309	-4.343	3.519	0	-113
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	-116	-7.108	1.135	0	-52
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	-182	0	0	-27	-86
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	-213	-13.524	4.376	0	-97
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	-288	-18.911	1.465	0	-124
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACION	-100	-5.013	5.013	0	-36
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	-788	0	0	-998	-780
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	-369	0	0	-195	-179
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	-332	0	0	-172	-163
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	-63	0	0	0	-15
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	-129	-28.965	12.309	0	-12.289
CEDULAS TDA 6, FTA	0	0	0	0	0
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	-119	-89.800	1.182	0	-87
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	-21	0	164	-225	-13
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	-60	0	1.093	-2.311	-46
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	-53	0	158	-1.073	-39
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	-70	0	17.631	-18.008	-24
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	-77	0	10.439	-10.822	-24
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	-146	0	0	-383	-24
FTA UCI 11	-68	-1.349	4.339	-1.019	-24
FTA UCI 14	-45	-2.512	16.077	0	-24
FTA UCI 16	-80	-3.930	26.415	-987	-24
FTA, UCI 15	-60	-3.402	15.350	0	-24
FTA, UCI 17	-71	-3.691	18.151	-28	-24
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	-59	0	0	0	-311
FTH UCI 12	-46	-1.110	4.874	-1.085	-24
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	-369	-437	0	-23	-50
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	-76	-5.298	0	-1	-36
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	-77	-280	0	-1	-36
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO X	-78	-5.246	0	-1	-36
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2	-67	-12.303	5.189	0	-56
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	-125	-23.781	0	0	-631
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	-80	-5.444	0	-1	-36
FTPYME TDA CAM 4, FTA	-17	0	0	0	-7
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	-36	0	430	-429	-10
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	-24	0	0	-189	-12
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	-32	0	2.521	-4.708	-66
HIPOCAT 10, FTA	-57	0	6.631	-6.631	-10
HIPOCAT 11, FTA	-78	0	8.613	-8.613	-10
HIPOCAT 9, FTA	-49	0	3.144	-3.145	-10
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	-84	0	32	-112	-66
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	-95	0	142	-225	-72
IM ANDBANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	-80	0	133	-133	-34
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	-66	-2.569	24.681	0	-49
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	-74	-18.844	17.615	0	-90

Miles de euros

FONDO	COMISIÓN VARIABLE				
	COMISIÓN GESTORA DEVENGADA EN EL PERIODO	IMPORTE DEVENGADO EN EL PERIODO	IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR (1)	CORRECCIONES DE VALOR POR REPERCUSIÓN DE PÉRDIDAS (1)	OTRAS COMISIONES DEVENGADAS EN EL PERIODO
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	-73	-5.784	28.653	0	-87
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACIÓN	-80	-16.477	26.463	0	-107
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACIÓN	-59	-6.564	14.799	0	-44
IM BCG RMBS 2, FTA	-91	-1.360	41.383	0	-84
IM CAJAMAR 3, FTA	-60	-1.367	10.517	0	-16
IM CAJAMAR 4, FTA	-61	-857	2.200	0	-17
IM CAJAMAR 5, FTA	-52	0	2.780	-951	-20
IM CAJAMAR 6, FTA	-73	0	8.911	-3.148	-32
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	-76	0	5.707	-1.862	-36
IM PASTOR 2, FTH	-8	0	3.236	-291	-9
IM PASTOR 3, FTH	-27	0	27.537	-27.537	-22
IM PASTOR 4, FTA	-31	0	10.364	-10.364	-27
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	-85	0	0	0	-44
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	-78	0	0	0	-41
MADRID RMBS I, FTA	-115	0	0	0	-19
MADRID RMBS II, FTA	-104	0	0	0	-21
MADRID RMBS III FTA	-135	0	0	0	-46
MADRID RMBS IV, FTA	-137	0	0	0	-104
MBS BANCAJA 3, FTA	-35	0	8.290	-755	-9
MBS BANCAJA 4, FTA	-54	0	31.353	-2.345	-29
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACIÓN	-67	-12.837	0	0	-98
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACIÓN	-78	-58.589	0	0	-14.984
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	0	0	0	0	0
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACIÓN	-74	0	0	-13	-18
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACIÓN	-69	0	0	0	-1.065
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACIÓN	-911	0	23.332	-21.837	-49
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACIÓN	-1.168	0	1.540	-1.597	-33
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	-51	-1.344	5.215	0	-27
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	-46	-654	2.627	0	-18
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	-55	-1.781	1.586	0	-40
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	-67	-1.801	1.137	0	-50
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	-39	-288	913	0	-30
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	-18	0	528	-538	-13
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACIÓN	-96	-179	972	0	-36
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	-31	0	1.016	-1.045	-26
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	-13	0	352	-358	-11
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	-14	0	142	-172	-9
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACIÓN	-63	-83	715	0	-22
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE TITULIZACIÓN	-215	0	0	0	-108
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACIÓN	-74	0	0	0	-26
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	-142	-3.724	10.296	-616	-173
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACIÓN	-99	-19.944	3.359	0	-423
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACIÓN	-100	-10.676	2.572	0	-272
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACIÓN	-176	-19.233	9.176	0	-885
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACIÓN	-35	0	0	0	-161
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACIÓN	-209	-34.137	8.693	0	-48
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACIÓN	-93	0	0	-7	-11
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACIÓN	-86	0	0	0	-310
TDA 19 - MIXTO, FTA	-72	-532	0	0	0
TDA 22 - MIXTO, FTA	-124	0	0	0	0
TDA 24, FTA	-139	0	0	0	-13
TDA 25, FTA	-55	0	0	0	-13
TDA 26 - MIXTO, FTA	-62	-1.060	0	0	-27
TDA 27, FTA	-62	0	0	0	-17

Miles de euros

FONDO	COMISIÓN VARIABLE				
	COMISIÓN GESTORA DEVENGADA EN EL PERIODO	IMPORTE DEVENGADO EN EL PERIODO	IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR (1)	CORRECCIONES DE VALOR POR REPERCUSIÓN DE PÉRDIDAS (1)	OTRAS COMISIONES DEVENGADAS EN EL PERIODO
TDA 28, FTA	-33	0	0	0	-64
TDA 29, FTA	-61	-1.256	0	0	-17
TDA 30, FTA	-33	-426	0	0	-16
TDA CAJAMAR 2, FTA	-43	-5.366	0	0	-15
TDA CAM 4, FTA	-50	-2.568	0	0	-9
TDA CAM 5, FTA	-79	-3.761	0	0	-9
TDA CAM 6, FTA	-63	0	0	0	-9
TDA CAM 7, FTA	-74	-2.109	0	0	-9
TDA CAM 8, FTA	-68	-470	0	0	-7
TDA CAM 9, FTA	-75	0	0	0	-9
TDA IBERCAJA 3, FTA	-42	-1.165	0	0	-26
TDA IBERCAJA 4, FTA	-73	-2.608	0	0	-31
TDA IBERCAJA 5, FTA	-68	-2.400	0	0	-33
TDA IBERCAJA 6, FTA	-61	-1.255	0	0	-39
TDA IBERCAJA 7, FTA	-102	-2.686	0	0	-14
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	-52	0	0	0	-26
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	-179	0	0	0	-365
TDA TARRAGONA 1, FTA	-41	-344	0	0	-10
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	-42	-148	5.627	-3	-17
Subtotal BONOS 2023	-18.660	-986.589	829.927	-301.906	-46.564
Subtotal BONOS 2022	-18.822	-1.310.290	793.377	-273.067	-35.532
%Variación	-0,86	-24,70	4,61	10,56	31,05
PAGARES					
Subtotal PAGARÉS 2023	0	0	0	0	0
Subtotal PAGARÉS 2022	0	0	0	0	0
%Variación	-	-	-	-	-
PRIVADOS					
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE TITULIZACION	-70	0	0	0	-86
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	-82	-2.020	0	0	-8
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	-145	-661	163	-163	-82
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	0	0	0	0	0
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACION	-82	0	0	0	-62
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	-91	-3.958	4.412	0	-12
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE TITULIZACION	-32	-163	0	0	-121
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACION	-73	0	0	0	-129
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACION	-78	-1.555	403	-15	-26
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	-54	0	52	0	-150
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	-29	0	0	-1	-4
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACION	-43	-20.131	0	0	-15
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	-160	0	0	0	-30
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	-1.129	0	5.967	0	-8
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	-148	-1.833	1.833	0	-2
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	-100	0	192	-179	-9
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	-133	0	149	-149	-10
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	-220	0	40	0	-17
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	-252	0	383	-252	-16
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	-454	0	1.262	-1.262	-8
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	-2	0	20	-6	0
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	-114	0	0	0	-9
FTA2015, FTA	-377	0	0	0	-7.810
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	-78	-881	881	0	-71
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	-58	-1.127	973	0	-37
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	-131	-3.161	899	0	-39

Miles de euros

FONDO	COMISIÓN VARIABLE				
	COMISIÓN GESTORA DEVENGADA EN EL PERIODO	IMPORTE DEVENGADO EN EL PERIODO	IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR (1)	CORRECCIONES DE VALOR POR REPERCUSIÓN DE PÉRDIDAS (1)	OTRAS COMISIONES DEVENGADAS EN EL PERIODO
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	-95	-665	1.724	0	-8
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	-46	-316	6	0	-281
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	-69	-3.187	841	0	-196
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	-125	0	0	0	-444
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	-136	0	0	0	-926
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	-50	0	0	0	-60
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	-76	-802	281	0	-101
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE TITULIZACION	-66	-1.853	0	0	-30
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	-51	0	0	0	-31
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	-69	-25	25	0	-480
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	-33	0	0	0	-6
PENSIUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	-44	0	0	-17	-29
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	-78	0	0	0	-525
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	-60	-8.270	1.038	0	-24
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	-73	0	0	0	-504
SLF, FONDO DE TITULIZACION	-31	0	0	0	-1.481
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	-35	0	0	0	-125
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	-51	-154	154	0	0
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	-62	-10.359	0	0	-82
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	-124	0	0	0	-143
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	-82	0	0	0	-75
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	-35	0	0	0	-21
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	-51	0	0	0	-1.543
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	-74	0	0	0	-4.742
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	-161	-3.938	1.828	0	-29
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE TITULIZACION	-85	-4.951	2.286	0	-75
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	-72	0	0	0	-12.512
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	-103	0	0	-37	-197
Subtotal PRIVADOS 2023	-6.172	-70.009	25.812	-2.082	-33.431
Subtotal PRIVADOS 2022	-5.276	-35.808	13.781	-281	-30.635
%Variación	16,98	95,51	87,30	640,85	9,13
Total 2023	-24.832	-1.056.598	855.740	-303.988	-79.995
Total 2022	-24.098	-1.346.098	807.158	-273.348	-66.167
%Variación	3,04	-21,51	6,02	11,21	20,90

(1) Dato a 31 de diciembre.

Principales flujos de efectivo en el ejercicio

CUADRO C.1

Miles de euros

FONDO	ADQUISICIÓN / EMISIÓN		INTERESES		DERIVADOS COBERTURA		AMORTIZACIONES		PAGOS COMISIONES (2)	
	ACTIVOS FINANCIEROS	VALORES EMITIDOS	ACTIVOS TITULIZADOS	VALORES EMITIDOS	COBROS	PAGOS	ACTIVOS TITULIZADOS (1)	VALORES EMITIDOS	IMPORTE	% / TA (3)
BONOS										
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	12.238	-12.034	0	0	117.193	-124.450	-343	-0,29
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	5.616	-1.752	662	0	61.334	-65.062	-4.656	-10,41
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	22.341	-9.700	5.452	0	180.634	-189.125	-18.989	-10,66
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	0	0	39.479	-25.318	11.913	0	238.920	-246.759	-26.032	-5,47
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	0	0	26.295	-12.510	10.357	0	160.904	-167.695	-25.153	-10,50
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	0	0	49.057	-27.473	23.806	0	271.308	-280.239	-45.244	-7,69
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	-36.016	0	41.059	-27.613	6.030	-86	148.462	-115.807	-16.592	-3,30
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	-589.110	575.000	10.635	-7.616	1.068	0	21.137	0	-279	-0,05
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	0	0	4.008	-5.749	0	0	32.267	-32.198	-98	-0,06
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	0	0	1.955	-1.533	1.989	-1.852	8.651	-9.111	-33	-0,06
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	0	0	141.539	-141.388	0	0	1.600.000	-1.600.000	-151	-0,01
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	0	0	75.074	-75.000	0	0	0	0	-74	0,00
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	0	0	29.982	-16.703	4.391	-3.214	155.200	-159.510	-1.057	-0,10
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	0	0	4.619	-4.814	4.453	-3.442	33.684	-35.826	-62	-0,04
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	0	0	1.700	-1.972	1.981	-1.270	14.585	-15.352	-63	-0,10
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	0	0	4.493	-5.348	5.424	-4.210	36.364	-37.291	-64	-0,04
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	0	0	6.264	-7.426	3.551	-1.695	51.055	-53.003	-69	-0,03
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	0	0	4.774	-6.195	6.286	-4.490	35.372	-36.276	-61	-0,04
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	0	0	6.293	-7.252	-4.408	6.217	44.706	-46.973	-51	-0,02
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	0	0	4.512	-5.826	5.016	-3.519	32.476	-33.850	-77	-0,04
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	0	0	30.802	-42.027	36.509	-23.786	203.458	-207.131	-371	-0,03
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	0	0	9.782	-11.428	9.138	-4.493	71.150	-72.696	-129	-0,03
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	0	0	11.679	-12.575	9.495	-6.010	78.789	-84.302	-141	-0,03
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	0	0	4.042	-4.665	5.126	-3.078	25.578	-26.090	-321	-0,21
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	0	0	5.823	-5.906	6.586	-3.847	33.132	-32.965	-2.414	-1,36
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	0	0	0	0	0	0	0	0	-38	-18,34
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	0	0	2.147	-2.732	2.950	-2.093	17.492	-17.227	-1.141	-1,46
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	0	0	1.362	-1.361	1.429	-1.102	5.742	-6.391	-42	-0,10
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	0	0	3.986	-3.853	4.269	-3.376	24.327	-24.717	-194	-0,15
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	0	0	9.130	-7.797	8.976	-7.692	44.217	-44.074	-1.348	-0,50
BANCAJA 10, FTA	0	0	16.303	-22.778	15.369	-10.826	80.843	-79.351	-125	-0,02
BANCAJA 11, FTA	0	0	14.873	-11.798	13.728	-8.560	74.752	-80.850	-98	-0,02
BANCAJA 13, FTA	0	0	30.477	-33.927	30.184	-17.366	119.298	-112.791	-178	-0,02

Principales flujos de efectivo en el ejercicio

CUADRO C.1

Miles de euros

FONDO	ADQUISICIÓN / EMISIÓN		INTERESES		DERIVADOS COBERTURA		AMORTIZACIONES		PAGOS COMISIONES (2)	
	ACTIVOS FINANCIEROS	VALORES EMITIDOS	ACTIVOS TITULIZADOS	VALORES EMITIDOS	COBROS	PAGOS	ACTIVOS TITULIZADOS (1)	VALORES EMITIDOS	IMPORTE	% / TA (3)
BANCAJA 8, FTA	0	0	5.230	-6.081	4.305	-3.152	29.624	-43.022	-2.094	-1,27
BANCAJA 9, FTA	0	0	8.527	-9.390	7.959	-6.266	44.188	-40.889	-89	-0,03
BANKINTER 10, FTA	0	0	5.046	-6.884	5.430	-3.929	41.829	-42.156	-51	-0,03
BANKINTER 11, FTH	0	0	3.155	-4.170	3.336	-2.238	25.986	-26.665	-51	-0,05
BANKINTER 13 FTA	0	0	7.555	-9.083	7.024	-4.602	57.716	-61.763	-60	-0,02
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	0	0	10.714	-2.227	0	0	83.522	-95.836	-9.033	-6,99
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	43.275	-29.315	18.103	-945	255.516	-278.722	-31.335	-5,18
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	56.976	-40.418	35.050	-21.752	270.811	-286.551	-27.945	-3,34
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	-799.992	804.000	26.304	-20.714	15.099	-13.580	80.470	-70.280	-3.115	-0,42
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	0	0	48.722	-6.602	0	0	312.158	-329.140	-33.889	-6,02
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	0	0	72.051	-960	0	0	434.065	-455.717	-52.264	-5,65
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	-3.000.000	3.000.000	110.276	-40.685	0	0	600.202	-530.288	-47.082	-1,78
BBVA LEASING 1, FTA	0	0	248	-1.288	120	-243	1.752	-549	-60	-2,22
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	-2.400.000	2.400.000	6.942	0	0	0	74.370	0	0	0,00
BBVA RMBS 1, FTA	0	0	18.025	-18.893	22.236	-17.996	92.900	-92.342	-156	-0,03
BBVA RMBS 14, FTA	0	0	6.759	-10.667	0	0	37.881	-37.962	-94	-0,03
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	0	0	44.428	-24.989	0	0	173.941	-184.584	-11.331	-1,16
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	0	0	47.380	-42.388	53.524	-45.737	170.857	-180.294	-5.493	-0,38
BBVA RMBS 2, FTA	0	0	34.405	-35.369	41.616	-34.358	172.269	-171.176	-4.023	-0,39
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	0	0	49.994	-64.125	84.418	-48.558	213.794	-224.621	-20.018	-0,88
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	0	0	368.908	-342.422	409.504	-346.745	1.324.669	-1.350.918	-70.132	-0,64
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	0	0	23.670	-38.066	45.796	-19.350	99.474	-96.001	-7.684	-0,49
BBVA RMBS 3, FTA	0	0	34.504	-26.803	37.458	-32.399	118.221	-129.919	-276	-0,03
BBVA RMBS 5 FTA	0	0	59.137	-56.403	0	0	197.688	-192.051	-266	-0,02
BBVA RMBS 9, FTA	0	0	21.321	-14.699	0	0	64.274	-61.933	-3.108	-0,52
BBVA-6 FTPYME FTA	0	0	76	-440	77	-78	1.603	-379	-54	-2,00
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	0	0	3.232	-3.314	1.449	0	22.094	-21.866	-1.217	-1,08
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	0	0	1.062	-1.582	453	0	7.412	-7.048	-56	-0,07
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	0	0	565	-692	226	0	5.526	-4.908	-714	-2,63
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	0	0	56.687	-7.770	0	0	481.811	-575.680	-35.274	-5,70
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	-2.278.820	2.000.000	62.668	-44.089	0	0	328.725	0	-1.223	-0,06
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	13.763	-3.369	0	0	143.110	-155.451	-6.736	-2,36
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	0	0	23.991	-29.912	0	0	265.343	-295.676	-255	-0,04
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	0	0	25.962	-7.039	0	0	321.859	-354.545	-11.371	-1,55

Principales flujos de efectivo en el ejercicio

CUADRO C.1

Miles de euros

FONDO	ADQUISICIÓN / EMISIÓN		INTERESES		DERIVADOS COBERTURA		AMORTIZACIONES		PAGOS COMISIONES (2)	
	ACTIVOS FINANCIEROS	VALORES EMITIDOS	ACTIVOS TITULIZADOS	VALORES EMITIDOS	COBROS	PAGOS	ACTIVOS TITULIZADOS (1)	VALORES EMITIDOS	IMPORTE	% / TA (3)
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	0	0	31.674	-4.262	0	0	422.803	-439.609	-18.746	-1,97
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACIÓN	-2.999.988	3.000.000	6.839	0	0	0	81.021	0	0	0,00
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	220.034	-231.608	0	0	1.061.628	-1.085.039	-810	-0,01
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	0	0	45.854	-50.652	0	0	188.848	-193.201	-398	-0,02
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	43.999	-50.267	0	0	192.899	-198.100	-354	-0,03
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	0	0	1.660	-2.538	0	0	15.900	-15.632	-77	-0,09
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	-518.485	0	87.970	-47.519	0	0	522.632	0	-40.014	-3,19
CEDULAS TDA 6, FTA	0	0	116.250	-116.250	0	0	0	0	0	0,00
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	-436.952	0	109.075	-12.538	0	0	430.404	0	-93.046	-13,84
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	0	0	50	-63	75	-44	578	-365	-33	-0,39
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	0	0	3.021	-5.899	893	0	20.148	-19.546	-70	-0,06
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	0	0	2.263	-3.744	1.118	0	13.574	-14.251	-62	-0,07
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	0	0	81	-796	377	-101	2.841	-2.513	-70	-1,50
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	0	0	6.929	-9.034	10.782	-5.185	51.715	-48.908	-79	-0,03
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	0	0	14.403	-17.542	21.212	-10.861	86.889	-87.221	-149	-0,03
FTA UCI 11	0	0	2.975	-2.932	0	0	17.983	-16.770	-1.441	-1,52
FTA UCI 14	0	0	7.084	-6.988	0	0	42.444	-40.980	-2.543	-1,11
FTA UCI 16	0	0	12.821	-12.981	0	0	67.711	-66.472	-4.035	-1,04
FTA, UCI 15	0	0	9.437	-9.819	0	0	55.641	-55.117	-2.107	-0,74
FTA, UCI 17	0	0	11.295	-11.971	10.375	-10.614	60.034	-58.448	-3.787	-1,12
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	0	0	195.799	-138.231	0	0	1.855.805	-3.500.000	-1.598	-0,02
FTH UCI 12	0	0	3.895	-4.270	0	0	24.718	-23.520	-1.180	-0,92
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	0	0	44.452	-44.725	0	0	628.951	-764.929	-876	-0,07
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	0	0	13.002	-14.811	8.021	0	52.136	-53.611	-5.411	-1,36
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	0	0	12.843	-12.659	579	0	46.910	-47.857	-394	-0,11
FONDO DE TITULIZACIÓN RMBS PRADO X	0	0	15.665	-19.089	9.120	-123	54.154	-54.207	-5.362	-1,08
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2	0	0	17.746	-6.472	0	0	111.905	-116.648	-13.236	-6,90
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	0	0	31.285	-19.188	12.885	0	174.845	-184.215	-24.545	-5,82
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	0	0	12.861	-15.072	9.442	0	39.291	-41.587	-5.560	-1,31
FTPYME TDA CAM 4, FTA	0	0	1.150	-1.485	560	0	11.189	-9.566	-26	-0,03
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	0	0	447	-1.133	806	-439	9.584	-9.474	-46	-0,17
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	0	0	89	-1.416	180	-112	1.322	0	-33	-0,64
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	0	0	2.504	-3.461	3.860	-2.957	19.242	-19.955	-41	-0,04
HIPOCAT 10, FTA	0	0	4.253	-1.664	5.740	-3.557	26.457	-30.909	-69	-0,05

Principales flujos de efectivo en el ejercicio

CUADRO C.1

Miles de euros

FONDO	ADQUISICIÓN / EMISIÓN		INTERESES		DERIVADOS COBERTURA		AMORTIZACIONES		PAGOS COMISIONES (2)	
	ACTIVOS FINANCIEROS	VALORES EMITIDOS	ACTIVOS TITULIZADOS	VALORES EMITIDOS	COBROS	PAGOS	ACTIVOS TITULIZADOS (1)	VALORES EMITIDOS	IMPORTE	% / TA (3)
HIPOCAT 11, FTA	0	0	4.838	-3.229	6.051	-4.086	24.606	-27.499	-90	-0,05
HIPOCAT 9, FTA	0	0	2.949	-4.709	3.725	-2.431	18.789	-17.839	-60	-0,05
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	0	0	13.017	-11.548	0	0	110.433	-103.548	-97	-0,02
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	0	0	14.429	-13.948	0	0	106.573	-101.205	-107	-0,02
IM ANDBANK RMBS 1,FONDO DE TITULIZACION	0	0	3.860	-4.333	0	0	64.946	-68.866	-240	-0,23
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	13.743	-12.176	0	0	62.611	-60.690	-1.575	-0,44
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	0	0	18.063	-191	0	0	88.656	-85.601	-17.572	-3,63
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	20.003	-16.489	0	0	173.984	-176.669	-240	-0,05
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	20.449	-4.704	0	0	172.422	-173.625	-267	-0,05
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	7.858	-2.200	0	0	75.181	-85.818	-5.425	-2,90
IM BCG RMBS 2, FTA	0	0	20.877	-16.828	0	0	83.853	-88.312	-234	-0,04
IM CAJAMAR 3, FTA	0	0	4.548	-4.894	0	0	29.005	-26.898	-5.233	-3,58
IM CAJAMAR 4, FTA	0	0	4.852	-5.640	0	0	31.429	-28.884	-4.589	-3,02
IM CAJAMAR 5, FTA	0	0	4.802	-5.989	0	0	31.708	-28.808	-3.635	-2,34
IM CAJAMAR 6, FTA	0	0	12.258	-15.582	0	0	65.086	-60.184	-5.004	-1,24
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	0	0	5.638	-6.757	1.161	0	30.818	-30.889	-170	-0,07
IM PASTOR 2, FTH	0	0	909	-1.493	579	0	10.142	-10.353	-351	-0,87
IM PASTOR 3, FTH	0	0	1.871	-3.667	0	372	15.529	-14.355	-490	-0,53
IM PASTOR 4, FTA	0	0	2.533	-4.250	0	705	18.336	-17.176	-115	-0,10
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	0	0	9.947	-4.378	876	0	39.787	-19.941	-129	-0,04
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	0	0	9.530	-4.511	1.089	0	34.735	-20.784	-126	-0,05
MADRID RMBS I, FTA	0	0	16.684	-13.703	1.641	0	83.177	-83.663	-139	-0,03
MADRID RMBS II, FTA	0	0	14.455	-12.003	409	0	72.227	-71.380	-126	-0,03
MADRID RMBS III, FTA	0	0	28.808	-16.336	1.930	0	126.496	-139.758	-182	-0,02
MADRID RMBS IV, FTA	0	0	21.808	-20.557	1.352	0	96.893	-90.721	-242	-0,04
MBS BANCAJA 3, FTA	0	0	2.366	-3.216	2.088	-1.543	16.411	-15.768	-399	-0,49
MBS BANCAJA 4, FTA	0	0	7.183	-11.156	6.093	-3.995	48.387	-43.769	-1.411	-0,55
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	-367.581	0	54.475	-27.731	0	0	350.649	0	-13.002	-1,49
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	-633.813	0	55.983	-720	0	0	754.590	-136.222	-73.682	-5,33
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	0	0	217.388	-217.388	0	0	0	0	0	0,00
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACION	-490.000	490.000	11.628	-13.230	0	0	36.035	-33.568	-76	-0,02
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	-304.076	310.500	5.923	-7.025	0	0	18.959	-18.055	-1.427	-0,71
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	0	0	98.392	-106.771	0	0	600.716	-613.274	-948	-0,03
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	0	0	118.989	-117.969	0	0	568.551	-576.958	-1.200	-0,03
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	0	0	7.227	-7.886	6.672	-4.169	41.567	-39.521	-4.836	-2,10

Principales flujos de efectivo en el ejercicio

CUADRO C.1

Miles de euros

FONDO	ADQUISICIÓN / EMISIÓN		INTERESES		DERIVADOS COBERTURA		AMORTIZACIONES		PAGOS COMISIONES (2)	
	ACTIVOS FINANCIEROS	VALORES EMITIDOS	ACTIVOS TITULIZADOS	VALORES EMITIDOS	COBROS	PAGOS	ACTIVOS TITULIZADOS (1)	VALORES EMITIDOS	IMPORTE	% / TA (3)
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	0	0	4.119	-4.170	3.467	-2.240	25.988	-24.923	-2.805	-2,13
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	0	0	10.562	-11.473	10.099	-6.606	54.981	-55.576	-1.447	-0,43
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	0	0	14.040	-15.686	13.888	-10.074	69.115	-69.376	-2.196	-0,49
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	0	0	8.320	-8.315	7.367	-6.282	35.305	-35.038	-229	-0,09
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	0	0	2.287	-2.353	0	0	11.891	-11.949	-25	-0,03
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	0	0	11.432	-10.448	0	0	55.996	-56.249	-105	-0,04
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	0	0	6.665	-6.642	0	0	33.444	-34.047	-41	-0,02
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	0	0	1.571	-1.500	0	0	10.615	-11.254	-20	-0,04
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	0	0	1.208	-896	0	0	6.959	-6.685	-20	-0,05
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	0	0	6.074	-5.634	0	0	29.421	-29.654	-71	-0,05
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE TITULIZACION	-650.000	659.500	11.329	0	0	0	62.167	0	0	0,00
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	9.664	-7.094	4.505	0	94.280	-102.972	-101	-0,09
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	0	0	38.494	-32.202	17.035	-9.453	201.251	-218.186	-1.639	-0,36
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	0	0	22.359	-10.109	9.267	-409	140.355	-143.833	-19.692	-8,55
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	14.091	-7.837	5.004	0	86.271	-88.403	-9.697	-5,64
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	-188.884	0	46.149	-32.887	21.784	-11.249	188.043	-3.500	-11.121	-1,51
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	-617.885	610.500	8.001	-6.115	4.394	-3.863	22.555	-2.546	-171	-0,03
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	54.718	-31.255	22.554	0	396.053	-419.968	-34.829	-5,36
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	-800.000	816.000	18.606	-15.982	13.141	-11.016	110.465	-109.090	-90	-0,01
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	-2.937.458	0	511.425	-567.992	82.244	0	2.868.624	0	-112	0,00
TDA 19 - MIXTO, FTA	0	0	1.079	-1.347	54	0	7.966	-7.167	-604	-1,47
TDA 22 - MIXTO, FTA	0	0	1.447	-1.922	35	0	8.122	-7.259	-124	-0,24
TDA 24, FTA	0	0	1.184	-1.487	0	-109	8.983	-7.810	-153	-0,27
TDA 25, FTA	0	0	1.967	-3.249	0	0	7.184	-4.379	-68	-0,14
TDA 26 - MIXTO, FTA	0	0	2.476	-2.856	867	0	15.761	-16.522	-1.149	-1,35
TDA 27, FTA	0	0	5.163	-4.561	0	0	23.090	-22.031	-79	-0,05
TDA 28, FTA	0	0	3.703	-5.035	0	0	11.541	-8.237	-100	-0,08
TDA 29, FTA	0	0	4.404	-4.867	1.548	0	21.794	-22.925	-1.334	-0,96
TDA 30, FTA	0	0	3.231	-3.674	929	0	11.814	-12.261	-475	-0,49
TDA CAJAMAR 2, FTA	0	0	3.381	-3.024	97	0	20.902	-18.443	-5.425	-6,10
TDA CAM 4, FTA	0	0	2.656	-3.046	1.250	0	28.347	-27.254	-2.627	-2,43
TDA CAM 5, FTA	0	0	6.818	-7.282	3.660	0	44.254	-44.639	-3.849	-1,44
TDA CAM 6, FTA	0	0	4.855	-5.078	2.351	0	28.471	-27.419	-71	-0,04

Principales flujos de efectivo en el ejercicio

CUADRO C.1

Miles de euros

FONDO	ADQUISICIÓN / EMISIÓN		INTERESES		DERIVADOS COBERTURA		AMORTIZACIONES		PAGOS COMISIONES (2)	
	ACTIVOS FINANCIEROS	VALORES EMITIDOS	ACTIVOS TITULIZADOS	VALORES EMITIDOS	COBROS	PAGOS	ACTIVOS TITULIZADOS (1)	VALORES EMITIDOS	IMPORTE	% / TA (3)
TDA CAM 7, FTA	0	0	7.667	-8.658	3.911	0	42.409	-42.326	-2.192	-0,73
TDA CAM 8, FTA	0	0	7.086	-8.317	3.455	0	45.415	-43.924	-546	-0,20
TDA CAM 9, FTA	0	0	7.774	-7.981	3.746	0	40.216	-38.682	-83	-0,03
TDA IBERCAJA 3, FTA	0	0	4.720	-4.714	574	0	26.367	-27.139	-1.233	-1,01
TDA IBERCAJA 4, FTA	0	0	7.201	-6.995	1.125	0	41.931	-42.679	-2.705	-1,40
TDA IBERCAJA 5, FTA	0	0	7.645	-7.280	1.241	0	39.514	-41.298	-2.497	-1,22
TDA IBERCAJA 6, FTA	0	0	12.809	-12.154	1.788	0	53.880	-58.302	-1.356	-0,39
TDA IBERCAJA 7, FTA	0	0	23.539	-25.024	4.188	0	102.053	-113.264	-2.802	-0,41
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	0	0	994	-2.642	1.013	0	15.732	-16.628	-77	-0,13
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	104.387	-129.378	52.401	0	455.596	-474.298	-186	-0,01
TDA TARRAGONA 1, FTA	0	0	1.771	-2.554	610	0	8.666	-8.809	-396	-0,62
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	0	0	3.253	-3.962	3.409	-2.367	23.251	-23.074	-517	-0,47
Subtotal BONOS 2023	-20.049.059	14.665.500	4.914.203	-4.164.878	1.457.608	-824.524	26.711.213	-23.325.313	-1.016.911	-0,72
Subtotal BONOS 2022	-25.472.055	20.647.313	2.949.698	-1.248.336	187.702	-270.239	24.962.630	-19.405.204	-1.433.054	-0,97
%Variación	-21,29	-28,97	66,60	233,63	676,55	205,11	7,00	20,20	-29,04	-25,61
PAGARES										
Subtotal PAGARÉS 2023	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00
Subtotal PAGARÉS 2022	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00
%Variación	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
PRIVADOS										
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE TITULIZACION	-250	250	0	0	0	0	250	0	-45	-21,94
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	-27.918	1.400	2.405	-853	0	0	29.298	0	-2.139	-18,16
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	-64.512	46.000	2.962	-2.162	0	0	17.836	0	-355	-0,23
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	0	0	1.400	-1.400	0	0	9.876	-9.876	-47	-0,23
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACION	0	0	62.869	-61.740	0	0	145.122	-145.770	-146	-0,13
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	10.662	-1.922	0	0	535.030	-618.964	-2.559	-0,98
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE TITULIZACION	-205.041	197.333	717	-374	0	0	111.737	-62.926	-750	-0,55
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	-778	1.764	0	0	0	0	0,00
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACION	-22.500	11.500	1.722	-1.112	0	0	11.000	0	-256	-0,82
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACION	-37.884	8.500	2.179	-518	0	0	32.934	0	-1.299	-10,83
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	-91.162	91.377	573	-250	0	0	99.964	-98.831	-253	-1,18
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	0	0	49	-31	0	0	53	-8	-35	-6,58
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACION	0	0	7.071	-672	0	0	22.026	-7.250	-20.189	-36,11
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	-393.159	987.053	0	-38.998	15.811	-15.650	0	0	-3.743	-0,33

Principales flujos de efectivo en el ejercicio

CUADRO C.1

Miles de euros

FONDO	ADQUISICIÓN / EMISIÓN		INTERESES		DERIVADOS COBERTURA		AMORTIZACIONES		PAGOS COMISIONES (2)	
	ACTIVOS FINANCIEROS	VALORES EMITIDOS	ACTIVOS TITULIZADOS	VALORES EMITIDOS	COBROS	PAGOS	ACTIVOS TITULIZADOS (1)	VALORES EMITIDOS	IMPORTE	% / TA (3)
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	0	0	0	-29.608	0	0	0	-41.056	-1.153	-0,46
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	0	142.500	0	-4.971	0	0	0	-13.638	-143	-0,09
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	0	0	0	-1.293	0	0	0	-3.678	-109	-1,37
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	0	0	0	-3.574	0	0	0	-14.480	-150	-0,63
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	0	0	0	-6.591	0	0	0	-39.939	-240	-0,38
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	0	0	0	-6.207	0	0	0	-39.367	-270	-0,50
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	0	0	0	-10.420	0	0	0	-38.861	-370	-0,38
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	0	0	532	-532	0	0	902	-902	0	0,00
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	-7.423	0	14.162	-10.315	0	0	52.367	-35.878	0	0,00
FTA2015, FTA	0	0	12.546	-110.189	0	0	103.206	0	-8.705	-2,30
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	-39.620	40.327	44	-148	0	0	3.398	-1.758	-144	-0,35
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	-34.888	29.000	0	-538	0	0	38.609	-31.062	-795	-6,63
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	-75.079	46.265	0	-790	0	0	79.253	-45.810	-2.557	-7,13
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	0	0	811	-369	0	0	1.529	-1.529	-103	-0,43
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	-64.751	65.173	2.031	-1.250	0	0	97.969	-98.750	-333	-0,49
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	-700.870	100.430	4.641	-2.467	0	0	754.987	-251.433	-3.156	-3,12
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	0	0	2.109	-2.234	0	0	20.239	-20.383	-816	-3,41
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	-40.000	40.044	10.042	-9.202	0	0	0	-44	-1.028	-0,27
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	0	0	645	-530	0	0	0	0	-115	-0,48
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	-130.986	44.127	1.816	-496	0	0	128.768	-36.504	-741	-2,53
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE TITULIZACION	-29.367	24.716	0	0	0	0	25.063	-12.300	-1.949	-13,38
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	0	0	3.946	-3.139	0	0	1.380	-1.460	-204	-0,20
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	-3.217	4.040	1.559	-224	0	0	210	0	-721	-6,85
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	-27.852	28.672	527	0	0	0	1.985	0	0	0,00
PENSIUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	-2.168	2.100	72	-43	0	0	234	0	-75	-3,40
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	-7.442	5.839	1.117	-659	46	-16	1.601	0	-461	-2,55
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	-3.008	0	0	18.240	-8.700	-6.563	-3,55
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	-28.799	29.200	2.645	-198	0	0	1.523	-1.780	-567	-1,94
SLF, FONDO DE TITULIZACION	0	0	6.285	-8.389	0	0	26.775	-21.469	-1.565	-1,90
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	0	0	1.665	-5.777	0	0	17.056	-12.410	-149	-0,25
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	0	0	-54	-0,01
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	-143.533	0	11.851	-1.960	0	0	143.134	0	-10.503	-2,58
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	-14.939	14.970	61.174	-61.603	0	0	89.940	-88.966	-263	-0,40
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	0	0	57.116	-55.160	0	0	110.108	-111.334	-164	-0,19
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	0	0	-55	-0,44
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	-169	0	6.293	-854	0	0	7.348	-7.687	-1.597	-1,65

Principales flujos de efectivo en el ejercicio

CUADRO C.1

Miles de euros

FONDO	ADQUISICIÓN / EMISIÓN		INTERESES		DERIVADOS COBERTURA		AMORTIZACIONES		PAGOS COMISIONES (2)	
	ACTIVOS FINANCIEROS	VALORES EMITIDOS	ACTIVOS TITULIZADOS	VALORES EMITIDOS	COBROS	PAGOS	ACTIVOS TITULIZADOS (1)	VALORES EMITIDOS	IMPORTE	% / TA (3)
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	0	0	22.492	-3.381	0	0	20.295	-30.429	-4.814	-3,10
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	-182.146	50.175	0	-3.187	0	0	142.161	-375	-2.338	-2,36
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE TITULIZACION	-177.195	144.270	9.067	-4.702	0	0	43.064	-4.498	-2.814	-1,98
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	0	0	21.168	0	0	0	77.671	-91.108	-11.694	-4,24
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	-8.493	0	1.896	-1.106	0	0	11.795	-7.000	-269	-1,54
Subtotal PRIVADOS 2023	-2.561.365	2.155.260	350.861	-465.928	17.620	-15.666	3.035.933	-2.058.212	-99.559	-1,48
Subtotal PRIVADOS 2022	-3.684.400	2.690.314	96.957	-372.852	622	-20	3.439.408	-3.028.482	-64.196	-0,99
%Variación	-30,48	-19,89	261,87	24,96	2.732,81	78.230,47	-11,73	-32,04	55,09	50,15
Total 2023	-22.610.424	16.820.760	5.265.064	-4.630.806	1.475.228	-840.190	29.747.146	-25.383.525	-1.116.470	-0,76
Total 2022	-29.156.455	23.337.627	3.046.655	-1.621.188	188.324	-270.259	28.402.038	-22.433.686	-1.497.250	-0,97
%Variación	-22,45	-27,92	72,81	185,64	683,35	210,88	4,74	13,15	-25,43	-22,10

(1) Incluye, además de las amortizaciones de activos titulizados, los cobros por amortizaciones de activos previamente clasificados como fallidos y cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías.

(2) Pagos por comisiones y otros servicios financieros.

(3) Porcentaje que representan dichos pagos sobre el total activo a 31 de diciembre.