



Estadísticas de fondos de titulización de activos

Abril 2017

Índice

Capítulo 1.- Número de fondos e importes emitidos

Cuadro 1.1.- Número de fondos de titulización registrados durante el periodo. Distribución por tipo de activo cedido

Cuadro 1.2.- Importe nominal emitido de bonos y pagarés de titulización. Distribución por tipo de activo cedido

Cuadro 1.3.- Importe nominal emitido de bonos y pagarés de titulización. Distribución según naturaleza del cedente

Cuadro 1.4.- Importe nominal emitido de bonos de titulización. Distribución según calificación crediticia

Capítulo 2.- Importes suscritos de los bonos de titulización

Cuadro 2.1.- Importe suscrito de los bonos de titulización. Distribución según sector del suscriptor

Cuadro 2.2.- Importe suscrito de los bonos de titulización de fondos registrados en abril de 2017. Distribución según sector del suscriptor y calificación crediticia

Capítulo 3.- Mejoras crediticias

Cuadro 3.1.- Número de fondos de titulización registrados durante el periodo, distribuidos por mejoras crediticias

Cuadro 3.2.- Porcentaje medio de cobertura sobre el importe cedido de las mejoras crediticias

Cuadro 3.3.- Número de fondos de titulización registrados durante abril de 2017. Distribución por tipo de activo cedido y mejoras crediticias

Capítulo 4.- Saldos vivos

Cuadro 4.1.- Saldo vivo de los bonos y pagarés de titulización en los mercados secundarios organizados españoles. Distribución por tipo de activo cedido

Cuadro 4.2.- Saldo vivo de los bonos de titulización en los mercados secundarios organizados españoles. Distribución según calificación crediticia

Cuadro 4.3.- Saldo vivo de los bonos y pagarés de titulización en los mercados secundarios organizados españoles. Distribución según naturaleza del cedente

Cuadro 4.4.- Saldo vivo de los bonos de titulización en los mercados secundarios organizados españoles. Distribución por tipo de activo cedido y calificación crediticia

Capítulo 5.- Contratación en los mercados secundarios organizados

Cuadro 5.1.- Contratación en los mercados secundarios organizados españoles. Distribución por tipo de activo cedido

Capítulo 6.- Datos individuales

Cuadro 6.1.- Emisiones registradas durante los últimos doce meses

Capítulo 1.- Número de fondos e importes emitidos

Número de fondos de titulización registrados durante el periodo
Distribución por tipo de activo cedido

CUADRO 1.1

| Número de fondos ¹ | 2016 | | | 2017 | | | | |
|--|-----------|-----------|-----------|----------|----------|-----------|----------|-----------------|
| | 2014 | 2015 | 2016 | II | III | IV | I | II ² |
| FTH (a) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| FTA | 16 | 22 | 31 | 8 | 5 | 13 | 7 | 3 |
| FTA hipotecarios | 6 | 6 | 8 | 2 | 0 | 3 | 3 | 0 |
| Préstamos hipotecarios (b) | 6 | 6 | 8 | 2 | 0 | 3 | 3 | 0 |
| Cédulas hipotecarias (c) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Préstamos a promotores (d) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| FTA empresas | 4 | 6 | 4 | 0 | 2 | 2 | 0 | 0 |
| PYMES | 4 | 5 | 3 | 0 | 2 | 1 | 0 | 0 |
| Préstamos a empresas | 0 | 1 | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 |
| Préstamos corporativos | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Arrendamiento financiero | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| FTA otros | 6 | 10 | 19 | 6 | 3 | 8 | 4 | 3 |
| Deuda subordinada | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bonos tesorería | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Créditos AA.PP. | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Cédulas territoriales | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Préstamos consumo | 1 | 1 | 3 | 1 | 1 | 1 | 2 | 0 |
| Préstamos auto | 1 | 2 | 4 | 0 | 1 | 1 | 0 | 0 |
| Cuentas a cobrar | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Derechos de créditos futuros | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bonos de titulización | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Otros créditos | 4 | 7 | 12 | 5 | 1 | 6 | 2 | 3 |
| TOTAL FONDOS DE BONOS DE TITULIZACIÓN | 16 | 22 | 31 | 8 | 5 | 13 | 7 | 3 |
| FONDOS DE PAGARÉS DE TITULIZACIÓN | 1 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 1 | 0 |
| TOTAL FONDOS DE BONOS Y PAGARÉS | 17 | 23 | 32 | 8 | 5 | 13 | 8 | 3 |
| Pro memoria: | | | | | | | | |
| Hipotecarios (a+b+c+d) | 6 | 6 | 8 | 2 | 0 | 3 | 3 | 0 |
| Fondos privados ³ | 2 | 5 | 1 | 1 | 0 | 0 | 2 | 2 |
| Fondos de activos bancarios (FAB) ³ | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

1 Número de expedientes: incluye los programas de pagarés registrados, las renovaciones de los mismos y las emisiones amparadas en programas de fondos.

2 Último dato disponible: abril de 2017.

3 No incluido en el total anterior.

Importe nominal emitido de bonos y pagarés de titulización.
Distribución por tipo de activo cedido

CUADRO 1.2

| Millones de euros | | | | 2016 | | | 2017 | |
|--|---------------|---------------|---------------|--------------|--------------|---------------|--------------|-----------------|
| | 2014 | 2015 | 2016 | II | III | IV | I | II ¹ |
| Mediante FTH (a) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Mediante FTA | 29.008 | 28.370 | 35.505 | 4.656 | 4.186 | 9.625 | 6.525 | 580 |
| FTA hipotecarios | 17.310 | 9.458 | 19.621 | 2.082 | 0 | 2.168 | 3.510 | 0 |
| Préstamos hipotecarios (b) | 17.310 | 9.458 | 19.621 | 2.082 | 0 | 2.168 | 3.510 | 0 |
| Cédulas hipotecarias (c) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Préstamos a promotores (d) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| FTA empresas | 8.750 | 14.124 | 7.500 | 0 | 2.750 | 4.750 | 0 | 0 |
| PYMES | 8.750 | 11.124 | 5.000 | 0 | 2.750 | 2.250 | 0 | 0 |
| Préstamos a empresas | 0 | 3.000 | 2.500 | 0 | 0 | 2.500 | 0 | 0 |
| Préstamos corporativos | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Arrendamiento financiero | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| FTA otros | 2.948 | 4.788 | 8.384 | 2.574 | 1.436 | 2.707 | 3.015 | 580 |
| Deuda subordinada | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bonos tesorería | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Créditos AA.PP. | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Cédulas territoriales | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Préstamos consumo | 300 | 1.450 | 3.015 | 1.300 | 700 | 1.015 | 1.885 | 0 |
| Préstamos auto | 798 | 1.039 | 3.056 | 0 | 726 | 663 | 0 | 0 |
| Cuentas a cobrar | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Derechos de créditos futuros | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bonos de titulización | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Otros créditos | 1.850 | 2.299 | 2.313 | 1.274 | 10 | 1.029 | 1.130 | 580 |
| TOTAL BONOS DE TITULIZACIÓN | 29.008 | 28.370 | 35.505 | 4.656 | 4.186 | 9.625 | 6.525 | 580 |
| PAGARÉS DE TITULIZACIÓN EMITIDOS | 620 | 2.420 | 1.880 | 580 | 0 | 740 | 0 | 640 |
| TOTAL BONOS Y PAGARÉS | 29.628 | 30.790 | 37.385 | 5.236 | 4.186 | 10.365 | 6.525 | 1.220 |
| Pro memoria: | | | | | | | | |
| Hipotecarios (a+b+c+d) | 17.310 | 9.458 | 19.621 | 2.082 | 0 | 2.168 | 3.510 | 0 |
| Fondos privados ² | 126 | 4.416 | 48 | 48 | 0 | 0 | 195 | 207 |
| Fondos de activos bancarios (FAB) ² | 101 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

1 Último dato disponible: abril de 2017.

2 No incluido en el total anterior. Importes de constitución de los fondos.

Importe nominal emitido de bonos y pagarés de titulización.
Distribución según naturaleza del cedente

CUADRO 1.3

| Millones de euros | 2016 | | | 2017 | | | | |
|------------------------------|---------------|---------------|---------------|--------------|--------------|---------------|--------------|-----------------|
| | 2014 | 2015 | 2016 | II | III | IV | I | II ¹ |
| Bancos | 27.688 | 27.110 | 29.261 | 3.962 | 2.450 | 8.089 | 4.605 | 640 |
| Cajas de ahorro | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Cooperativas de crédito | 90 | 0 | 1.750 | 0 | 1.000 | 0 | 0 | 0 |
| EFC | 0 | 1.381 | 3.796 | 0 | 726 | 982 | 390 | 580 |
| ICO | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Otras sociedades financieras | 0 | 0 | 265 | 0 | 0 | 265 | 0 | 0 |
| Sociedades no financieras | 1.850 | 2.299 | 2.313 | 1.274 | 10 | 1.029 | 1.530 | 0 |
| TOTAL | 29.628 | 30.790 | 37.385 | 5.236 | 4.186 | 10.365 | 6.525 | 1.220 |

1 Último dato disponible: abril de 2017.

Importe nominal emitido de bonos de titulización.
Distribución según calificación crediticia

CUADRO 1.4

| Millones de euros | 2016 | | | 2017 | | | | |
|--------------------------|---------------|---------------|---------------|--------------|--------------|--------------|--------------|-----------------|
| | 2014 | 2015 | 2016 | II | III | IV | I | II ¹ |
| AAA | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| AA | 0 | 9.871 | 11.383 | 3.252 | 2.698 | 3.503 | 3.001 | 470 |
| A | 20.774 | 11.308 | 18.201 | 0 | 798 | 3.877 | 1.714 | 0 |
| BBB | 2.770 | 2.330 | 2.471 | 1.274 | 10 | 1.145 | 1.146 | 0 |
| BB | 262 | 0 | 74 | 0 | 0 | 51 | 136 | 0 |
| B | 2.474 | 394 | 534 | 130 | 389 | 15 | 0 | 0 |
| Menor que B ² | 2.728 | 4.467 | 2.843 | 0 | 291 | 1.034 | 528 | 110 |
| TOTAL | 29.008 | 28.370 | 35.505 | 4.656 | 4.186 | 9.625 | 6.525 | 580 |

Nota: Rating agrupados según su equivalente a Standard and Poor's.

1 Último dato disponible: abril de 2017.

2 Incluye las emisiones sin rating.

Capítulo 2.- Importes suscritos de los bonos de titulización

Importe suscrito de los bonos de titulización. Distribución según sector del suscriptor

CUADRO 2.1

| Millones de euros | | | | 2016 | | | 2017 | |
|---|---------------|---------------|---------------|--------------|--------------|--------------|--------------|-----------------|
| | 2014 | 2015 | 2016 | II | III | IV | I | II ¹ |
| Instituciones Financieras | 24.478 | 24.970 | 31.912 | 4.589 | 3.549 | 8.540 | 5.326 | 110 |
| Banco de España | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Entidades de crédito | 23.957 | 24.730 | 31.896 | 4.589 | 3.549 | 8.540 | 5.088 | 110 |
| Residentes españolas | 23.957 | 24.730 | 31.146 | 3.839 | 3.549 | 8.540 | 5.088 | 110 |
| Residentes extranjeras | 0 | 0 | 750 | 750 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Otras Instituciones Financieras | 521 | 240 | 16 | 0 | 0 | 0 | 239 | 0 |
| Fondos de garantía | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Entidades de Inversión | 521 | 240 | 16 | 0 | 0 | 0 | 231 | 0 |
| Auxiliares Financieros | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 8 | 0 |
| Empresas de seguros | 86 | 177 | 317 | 0 | 316 | 1 | 137 | 0 |
| Administración Pública | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Empresas no Financieras | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Empresas no Financieras | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Familias | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Instituciones privadas sin fines de lucro | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| TOTAL MERCADO ESPAÑOL | 24.565 | 25.147 | 32.229 | 4.589 | 3.865 | 8.541 | 5.463 | 110 |
| Instituciones Financieras | 4.070 | 2.529 | 3.251 | 67 | 296 | 1.084 | 1.039 | 470 |
| Resto | 373 | 694 | 25 | 0 | 25 | 0 | 22 | 0 |
| TOTAL MERCADO EXTRANJERO | 4.443 | 3.222 | 3.276 | 67 | 321 | 1.084 | 1.062 | 470 |
| TOTAL SUSCRITO | 29.008 | 28.370 | 35.505 | 4.656 | 4.186 | 9.625 | 6.525 | 580 |
| por el propio cedente o emisor | 23.126 | 24.355 | 28.084 | 2.632 | 3.539 | 7.463 | 4.774 | 0 |

¹ Último dato disponible: abril de 2017.

Importe suscrito de los bonos de titulización de fondos registrados en abril 2017 Distribución según sector del suscriptor y calificación crediticia

CUADRO 2.2

| Millones de euros | AAA | AA | A | BBB | BB | B | Menor que B ¹ | TOTAL |
|---|----------|------------|----------|----------|----------|----------|--------------------------|------------|
| Instituciones Financieras | 0 | 470 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 470 |
| Banco de España | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Entidades de crédito | 0 | 470 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 470 |
| Residentes españolas | 0 | 470 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 470 |
| Residentes extranjeras | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Otras Instituciones Financieras | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fondos de garantía | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Entidades de Inversión | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Auxiliares Financieros | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Empresas de seguros | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Administración Pública | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Empresas no Financieras | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Empresas no Financieras | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Familias | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Instituciones privadas sin fines de lucro | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| TOTAL MERCADO ESPAÑOL | 0 | 470 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 470 |
| Instituciones Financieras | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 110 | 110 |
| Resto | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| TOTAL MERCADO EXTRANJERO | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 110 | 110 |
| TOTAL SUSCRITO | 0 | 470 | 0 | 0 | 0 | 0 | 110 | 580 |
| por el propio cedente o emisor | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

Nota: Rating agrupados según su equivalente a Standard and Poor's.

¹ Incluye las emisiones sin rating.

Capítulo 3.- Mejoras crediticias

Número de fondos de titulización registrados durante el periodo distribuidos por mejoras crediticias CUADRO 3.1

| Número | 2016 | | | 2017 | | | | |
|-------------------------------------|-----------|-----------|-----------|----------|----------|-----------|----------|-----------------|
| | 2014 | 2015 | 2016 | II | III | IV | I | II ¹ |
| NÚMERO DE FONDOS REGISTRADOS | 17 | 23 | 32 | 8 | 5 | 13 | 8 | 3 |
| Fondo de reserva | 13 | 16 | 20 | 3 | 4 | 7 | 6 | 0 |
| Sobrecolateralización | 0 | 1 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Exceso de spread ² | 3 | 7 | 12 | 5 | 1 | 6 | 2 | 0 |
| Swap | 0 | 3 | 2 | 0 | 1 | 0 | 1 | 0 |
| Línea de liquidez | 5 | 10 | 13 | 5 | 1 | 6 | 3 | 0 |
| Subordinación de series | 12 | 13 | 15 | 1 | 4 | 6 | 5 | 1 |
| Descuento en el precio | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Avales y garantías | 3 | 7 | 12 | 5 | 1 | 6 | 2 | 0 |

1 Último dato disponible: abril de 2017

2 Se consideran únicamente las operaciones sin swap, en las que los tipos de interés de referencia y periodos de devengo de intereses de los activos están ligados con los de los bonos .

Porcentaje medio de cobertura sobre el importe cedido de las mejoras crediticias¹ CUADRO 3.2

| % | 2016 | | | 2017 | | | | |
|-------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-----------------|
| | 2014 | 2015 | 2016 | II | III | IV | I | II ² |
| Fondo de reserva | 14,00 | 17,56 | 4,31 | 4,11 | 3,60 | 4,09 | 10,72 | 0,00 |
| Sobrecolateralización | 0,00 | 3,41 | 3,83 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Exceso de spread ³ | 0,30 | 0,30 | 0,30 | 0,30 | 0,30 | 0,30 | 0,30 | 0,00 |
| Línea de liquidez | 37,09 | 29,98 | 59,92 | 7,69 | 7,69 | 7,69 | 76,92 | 0,00 |
| Descuento en el precio | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Avales y garantías | 100,00 | 100,00 | 100,00 | 100,00 | 100,00 | 100,00 | 100,00 | 0,00 |

1 Porcentaje medio calculado entre los fondos que disponen de la mejora

2 Último dato disponible: abril de 2017.

3 Se consideran únicamente las operaciones sin swap, en las que los tipos de interés de referencia y periodos de devengo de intereses de los activos están ligados con los de los bonos .

Número de fondos de titulización registrados durante abril 2017
Distribución por tipo de activo cedido y mejoras crediticias.

CUADRO 3.3

| | FONDOS REGISTRADOS | Fondo de reserva | Sobrecolateraliz ación | Exceso de spread ¹ | Swap | Línea de liquidez | Subordinación de series | Descuento en el precio | Avales y garantías |
|--|-----------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------|----------|----------------------|----------------------------|---------------------------|-----------------------|
| FTH (a) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| FTA | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 |
| FTA hipotecarios | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Préstamos hipotecarios (b) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Cédulas hipotecarias (c) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Préstamos a promotores (d) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| FTA empresas | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PYMES | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Préstamos a empresas | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Préstamos corporativos | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Arrendamiento financiero | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| FTA otros | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 |
| Deuda subordinada | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bonos tesorería | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Créditos AA.PP. | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Cédulas territoriales | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Préstamos consumo | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Préstamos auto | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Cuentas a cobrar | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Derechos de créditos futuros | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bonos de titulización | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Otros créditos | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 |
| TOTAL FONDOS DE BONOS DE TITULIZACIÓN | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 |
| FONDOS DE PAGARÉS DE TITULIZACIÓN | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| TOTAL FONDOS DE BONOS Y PAGARÉS | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 |

Pro memoria:

Hipotecarios (a+b+c+d)

¹ Se consideran únicamente las operaciones sin swap, en las que los tipos de interés de referencia y periodos de devengo de intereses de los activos están ligados con los de los bonos.

Capítulo 4.- Saldos vivos

Saldo vivo de los bonos y pagarés de titulización en los mercados secundarios organizados españoles¹.
Distribución por tipo de activo cedido.

CUADRO 4.1

| Millones de euros | 2016 | | | 2017 | | | | |
|---|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|
| | 2014 | 2015 | 2016 | II | III | IV | I | II ² |
| Mediante FTH (a) | 7.989 | 7.010 | 6.184 | 6.566 | 6.374 | 6.184 | 5.958 | 5.920 |
| Mediante FTA | 246.842 | 216.473 | 213.684 | 214.898 | 212.282 | 213.684 | 209.237 | 208.913 |
| FTA hipotecarios | 185.768 | 167.120 | 162.896 | 168.379 | 165.842 | 162.896 | 161.031 | 159.130 |
| Préstamos hipotecarios (b) | 112.705 | 108.742 | 117.855 | 120.760 | 118.224 | 117.855 | 117.993 | 118.091 |
| Cédulas hipotecarias (c) | 72.985 | 58.310 | 44.980 | 47.555 | 47.555 | 44.980 | 42.980 | 40.980 |
| Préstamos a promotores (d) | 77 | 69 | 60 | 64 | 63 | 60 | 58 | 58 |
| FTA empresas | 31.045 | 21.960 | 20.577 | 17.007 | 17.586 | 20.577 | 18.698 | 18.112 |
| PYMES | 21.720 | 16.435 | 14.976 | 12.733 | 14.140 | 14.976 | 13.447 | 13.055 |
| Préstamos a empresas | 7.789 | 4.829 | 5.060 | 3.658 | 2.871 | 5.060 | 4.758 | 4.563 |
| Préstamos corporativos | 273 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Arrendamiento Financiero | 1.264 | 696 | 541 | 616 | 575 | 541 | 494 | 494 |
| FTA otros | 30.029 | 27.393 | 30.211 | 29.512 | 28.854 | 30.211 | 29.507 | 31.671 |
| Deuda Subordinada | 228 | 227 | 105 | 227 | 227 | 105 | 105 | 105 |
| Bonos Tesorería | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Créditos AAPP | 215 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Cédulas territoriales | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Préstamos consumo | 3.341 | 4.250 | 6.825 | 4.088 | 6.000 | 6.825 | 6.438 | 8.193 |
| Préstamos Auto | 3.178 | 2.835 | 4.757 | 3.879 | 3.625 | 4.757 | 4.542 | 4.481 |
| Cuentas a cobrar | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Derechos de créditos futuros | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bonos de titulización | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Otros Créditos | 23.067 | 20.081 | 18.524 | 21.318 | 19.003 | 18.524 | 18.422 | 18.892 |
| TOTAL BONOS DE TITULIZACIÓN | 254.831 | 223.484 | 219.868 | 221.464 | 218.656 | 219.868 | 215.195 | 214.832 |
| PAGARÉS DE TITULIZACIÓN EMITIDOS | 580 | 1.000 | 1.040 | 680 | 660 | 1.040 | 460 | 940 |
| TOTAL BONOS Y PAGARÉS | 255.411 | 224.484 | 220.908 | 222.144 | 219.316 | 220.908 | 215.655 | 215.772 |
| Pro memoria: | | | | | | | | |
| Hipotecarios (a+b+c+d) | 193.757 | 174.131 | 169.080 | 174.945 | 172.216 | 169.080 | 166.990 | 165.050 |

1 No incluye el MARF.

2 Último dato disponible: abril de 2017.

Saldo vivo de los bonos de titulización en los mercados secundarios organizados españoles¹.
Distribución según calificación crediticia

CUADRO 4.2

| Millones de euros | 2016 | | | 2017 | | | | |
|--------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|
| | 2014 | 2015 | 2016 | II | III | IV | I | II ² |
| AAA | 61 | 50 | 31 | 41 | 36 | 31 | 28 | 28 |
| AA | 19.364 | 44.896 | 52.886 | 50.658 | 50.922 | 52.886 | 53.779 | 56.378 |
| A | 101.547 | 59.297 | 65.762 | 64.177 | 63.279 | 65.762 | 62.792 | 65.518 |
| BBB | 85.949 | 88.187 | 70.233 | 76.250 | 73.596 | 70.233 | 67.441 | 61.628 |
| BB | 23.209 | 7.003 | 5.578 | 5.755 | 5.673 | 5.578 | 5.216 | 5.529 |
| B | 9.420 | 6.986 | 8.487 | 8.411 | 8.836 | 8.487 | 8.618 | 9.079 |
| Menor que B ³ | 15.280 | 17.065 | 16.890 | 16.171 | 16.314 | 16.890 | 17.322 | 16.672 |
| TOTAL | 254.831 | 223.484 | 219.868 | 221.464 | 218.656 | 219.868 | 215.195 | 214.832 |

1 No incluye el MARF.

2 Último dato disponible: abril de 2017.

3 Incluye las emisiones sin rating.

Nota: Rating agrupados según su equivalente a Standard and Poor's.

Saldo vivo de los bonos y pagarés de titulización en los mercados secundarios organizados españoles¹. CUADRO 4.3
Distribución según naturaleza del cedente

| Millones de euros | | | | 2016 | | | 2017 | |
|--------------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|
| | 2014 | 2015 | 2016 | II | III | IV | I | II ² |
| BONOS DE TITULIZACIÓN | | | | | | | | |
| Bancos | 100.311 | 93.898 | 106.477 | 102.031 | 102.171 | 106.477 | 105.653 | 104.552 |
| Cajas de ahorro | 109.517 | 89.869 | 73.471 | 78.331 | 77.379 | 73.471 | 70.383 | 70.005 |
| Cooperativas de crédito | 15.824 | 12.920 | 11.921 | 11.652 | 12.283 | 11.921 | 11.567 | 11.475 |
| EFC | 6.866 | 6.785 | 9.243 | 8.165 | 7.852 | 9.243 | 8.944 | 9.756 |
| ICO | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Otras sociedades financieras | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Sociedades no financieras | 22.312 | 20.011 | 18.756 | 21.284 | 18.969 | 18.756 | 18.649 | 19.044 |
| TOTAL BONOS | 254.831 | 223.484 | 219.868 | 221.464 | 218.656 | 219.868 | 215.195 | 214.832 |
| PAGARÉS DE TITULIZACIÓN | | | | | | | | |
| Bancos | 580 | 1.000 | 1.040 | 680 | 660 | 1.040 | 460 | 940 |
| Cajas de ahorro | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Cooperativas de crédito | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| EFC | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| ICO | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Otras sociedades financieras | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Sociedades no financieras | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| TOTAL PAGARÉS | 580 | 1.000 | 1.040 | 680 | 660 | 1.040 | 460 | 940 |
| TOTAL BONOS Y PAGARÉS | 255.411 | 224.484 | 220.908 | 222.144 | 219.316 | 220.908 | 215.655 | 215.772 |

1 No incluye el MARF.

2 Último dato disponible: abril de 2017.

Saldo vivo de los bonos de titulización en los mercados secundarios organizados españoles¹. CUADRO 4.4
Distribución por tipo de activo cedido y calificación crediticia

| Millones de euros | AAA | AA | A | BBB | BB | B | Menor que B ² | TOTAL |
|------------------------------|-----------|---------------|---------------|---------------|--------------|--------------|--------------------------|----------------|
| Mediante FTH (a) | 0 | 3.793 | 1.243 | 389 | 70 | 321 | 104 | 5.920 |
| Mediante FTA | 28 | 52.586 | 64.275 | 61.239 | 5.459 | 8.757 | 16.568 | 208.913 |
| FTA hipotecarios | 0 | 40.670 | 55.868 | 40.054 | 3.955 | 5.427 | 13.156 | 159.130 |
| Préstamos hipotecarios (b) | 0 | 39.379 | 47.355 | 8.819 | 3.955 | 5.427 | 13.156 | 118.091 |
| Cédulas hipotecarias (c) | 0 | 1.250 | 8.495 | 31.235 | 0 | 0 | 0 | 40.980 |
| Préstamos a promotores (d) | 0 | 41 | 18 | 0 | 0 | 0 | 0 | 58 |
| FTA empresas | 28 | 4.290 | 3.987 | 2.669 | 1.243 | 2.843 | 3.052 | 18.112 |
| PYMES | 28 | 4.135 | 3.506 | 568 | 187 | 2.720 | 1.911 | 13.055 |
| Préstamos a empresas | 0 | 154 | 278 | 2.101 | 1.056 | 123 | 850 | 4.563 |
| Préstamos corporativos | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Arrendamiento financiero | 0 | 0 | 203 | 0 | 0 | 0 | 291 | 494 |
| FTA otros | 0 | 7.626 | 4.421 | 18.516 | 260 | 487 | 361 | 31.671 |
| Deuda subordinada | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 105 | 105 |
| Bonos tesorería | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Créditos AA.PP. | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Cédulas territoriales | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Préstamos consumo | 0 | 4.050 | 3.292 | 73 | 159 | 486 | 134 | 8.193 |
| Préstamos auto | 0 | 3.107 | 1.129 | 125 | 69 | 0 | 52 | 4.481 |
| Cuentas a cobrar | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Derechos de créditos futuros | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bonos de titulización | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Otros créditos | 0 | 470 | 0 | 18.319 | 33 | 1 | 70 | 18.892 |
| TOTAL | 28 | 56.378 | 65.518 | 61.628 | 5.529 | 9.079 | 16.672 | 214.832 |
| Pro memoria: | | | | | | | | |
| Hipotecarios (a+b+c+d) | 0 | 44.463 | 57.110 | 40.442 | 4.026 | 5.749 | 13.260 | 165.050 |

1 No incluye el MARF.

2 Incluye las emisiones sin rating.

Nota: Rating agrupados según su equivalente a Standard and Poor's.

Capítulo 5.- Contratación

Contratación en los mercados secundarios organizados españoles¹.

CUADRO 5.1

Distribución por tipo de activo cedido

| Millones de euros | 2016 | | | 2017 | | | | |
|---|----------------|----------------|---------------|---------------|--------------|--------------|--------------|-----------------|
| | 2014 | 2015 | 2016 | II | III | IV | I | II ² |
| Mediante FTH (a) | 1.011 | 1.824 | 430 | 192 | 36 | 32 | 25 | 94 |
| Mediante FTA | 346.401 | 177.123 | 32.051 | 9.967 | 7.520 | 3.931 | 8.070 | 2.353 |
| FTA hipotecarios | 183.612 | 124.949 | 13.871 | 4.470 | 3.222 | 1.364 | 2.448 | 1.366 |
| Préstamos hipotecarios (b) | 103.928 | 86.599 | 5.508 | 825 | 1.324 | 917 | 797 | 876 |
| Cédulas hipotecarias (c) | 79.676 | 38.345 | 8.364 | 3.645 | 1.898 | 447 | 1.651 | 490 |
| Préstamos a promotores (d) | 8 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| FTA empresas | 37.835 | 10.841 | 3.114 | 657 | 790 | 437 | 185 | 14 |
| PYMES | 7.700 | 1.905 | 2.006 | 218 | 723 | 397 | 2 | 5 |
| Préstamos a empresas | 30.114 | 8.917 | 1.082 | 439 | 66 | 40 | 182 | 9 |
| Préstamos corporativos | 9 | 11 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Arrendamiento financiero | 13 | 8 | 26 | 1 | 1 | 0 | 1 | 0 |
| FTA otros | 124.954 | 41.333 | 15.065 | 4.840 | 3.508 | 2.130 | 5.438 | 973 |
| Deuda subordinada | 57 | 86 | 47 | 1 | 22 | 7 | 14 | 0 |
| Bonos tesorería | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Créditos AA.PP. | 137 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Cédulas territoriales | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Préstamos consumo | 3.424 | 3.609 | 505 | 0 | 505 | 0 | 0 | 58 |
| Préstamos auto | 453 | 3.046 | 2.785 | 199 | 253 | 644 | 127 | 1 |
| Cuentas a cobrar | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Derechos de créditos futuros | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bonos de titulización | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Otros créditos | 120.883 | 34.592 | 11.729 | 4.639 | 2.728 | 1.478 | 5.297 | 914 |
| TOTAL BONOS DE TITULIZACIÓN | 347.412 | 178.947 | 32.481 | 10.159 | 7.556 | 3.962 | 8.095 | 2.446 |
| PAGARÉS DE TITULIZACIÓN EMITIDOS | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| TOTAL BONOS Y PAGARÉS | 347.412 | 178.947 | 32.481 | 10.159 | 7.556 | 3.962 | 8.095 | 2.446 |
| Pro memoria: | | | | | | | | |
| Hipotecarios (a+b+c+d) | 184.622 | 126.773 | 14.301 | 4.662 | 3.259 | 1.395 | 2.473 | 1.459 |

1 No incluye el MARF.

2 Último dato disponible: abril de 2017.

Capítulo 6.- Datos individuales

Emissiones registradas durante los últimos doce meses

CUADRO 6.1

Importes en euros

| Fecha de registro | Activo titulado | Emisor | Serie | | | | Rating | | | TACP ¹ prevista media | Vida media (años) | Tipo de interés de referencia ² | Spread ³ | Precio (%) | | Inversores ⁴ | Importe |
|-------------------|------------------------|-----------------------------------|-------|---------|----------|----------|----------|---------|-----------|--|-------------------------|--|---------------------|------------|---------------|-------------------------|---------|
| | | | S&P | Moody's | Fitch | DBRS | Scope | Emisión | Reembolso | | | | | | | | |
| 05/05/2016 | Préstamos hipotecarios | BBVA RMBS 16 | AA2 | Aa2 | A(High) | AAA | AAA | 3,00 | 8,73 | E 3 | 0,50 | 100,00 | 100,00 | C | 1.344.000.000 | | |
| 19/05/2016 | Préstamos hipotecarios | HT ABANCA RMBS 1 | AA | BBB+ | AAA | AAA | AAA | 7,30 | 6,66 | E 3 | 0,30 | 100,00 | 100,00 | D | 738.000.000 | | |
| 07/06/2016 | Otros | FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT | 23 | BBB+ | BBB+ | BBB+ | BBB+ | 1,86 | 99,49 | | 1,86 | 100,00 | 100,00 | C | 120.000.000 | | |
| 07/06/2016 | Otros | FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT | 21 | BBB+ | BBB+ | A(Low) | BBB+ | 0,30 | 102,39 | | 0,30 | 100,00 | 100,00 | C | 380.000.000 | | |
| 07/06/2016 | Otros | FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT | 24 | BBB+ | BBB+ | BBB+ | BBB+ | 0,58 | 99,65 | | 0,58 | 100,00 | 100,00 | C | 670.000.000 | | |
| 07/06/2016 | Otros | FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT | 9 | BBB+ | BBB+ | A(Low) | BBB+ | 1,61 | 139,04 | | 1,61 | 100,00 | 100,00 | C | 51.500.000 | | |
| 07/06/2016 | Otros | FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT | 10 | BBB+ | BBB+ | A(Low) | BBB+ | 1,92 | 145,24 | | 1,92 | 100,00 | 100,00 | C | 52.000.000 | | |
| 21/06/2016 | Préstamos consumo | CAIXABANK CONSUMO 2 | A | Aa3 | A | A(Low) | A(Low) | 6,00 | 1,85 | E 3 | 1,00 | 100,00 | 100,00 | D | 1.170.000.000 | | |
| 21/06/2016 | Préstamos consumo | CAIXABANK CONSUMO 2 | B | B3 | B+ | BB | BB | 6,00 | 4,53 | E 3 | 1,50 | 100,00 | 100,00 | D | 130.000.000 | | |
| 07/07/2016 | Otros | FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT | 10 | BBB+ | BBB+ | A(Low) | BBB+ | 1,75 | 147,47 | | 1,75 | 100,00 | 100,00 | C | 10.000.000 | | |
| 14/07/2016 | Préstamos consumo | BBVA CONSUMO 8 | A | Aa2 | A | AAA | AAA | 8,00 | 2,17 | E 3 | 1,00 | 100,00 | 100,00 | D | 612.500.000 | | |
| 14/07/2016 | Préstamos consumo | BBVA CONSUMO 8 | B | B1 | CCC | BBB | BBB | 8,00 | 5,20 | E 3 | 1,50 | 100,00 | 100,00 | D | 87.500.000 | | |
| 21/07/2016 | PYMES | IM BCC CAJAMAR PYME 1 | A | A2 | A | CCC(Low) | CCC(Low) | 5,00 | 2,00 | E 1 | 0,20 | 100,00 | 100,00 | D | 745.000.000 | | |
| 21/07/2016 | PYMES | IM BCC CAJAMAR PYME 1 | B | Caa1 | | CCC(Low) | CCC(Low) | 5,00 | 6,94 | E 1 | 0,30 | 100,00 | 100,00 | D | 255.000.000 | | |
| 28/07/2016 | PYMES | IM SABADELL PYME 10 | Aa3 | Aa3 | AA | AA | AA | 6,25 | 1,97 | E 3 | 0,75 | 100,00 | 100,00 | D | 1.448.100.000 | | |
| 28/07/2016 | PYMES | IM SABADELL PYME 10 | B2 | B2 | CCC(Low) | B | CCC(Low) | 6,25 | 6,88 | E 3 | 0,90 | 100,00 | 100,00 | D | 301.900.000 | | |
| 30/09/2016 | Préstamos auto | AUTO ABS SPANISH LOANS 2016, FT | A | AA+ | AAA | AAA | AAA | 4,00 | 2,90 | E 1 | 0,75 | 100,00 | 100,00 | C | 637.200.000 | | |
| 30/09/2016 | Préstamos auto | AUTO ABS SPANISH LOANS 2016, FT | B | A- | A(High) | A(High) | A(High) | 4,00 | 5,00 | E 1 | 2,00 | 100,00 | 100,00 | D | 52.900.000 | | |
| 30/09/2016 | Préstamos auto | AUTO ABS SPANISH LOANS 2016, FT | C | | | | | 4,00 | 5,10 | E 3 | 3,00 | 100,00 | 100,00 | D | 29.900.000 | | |
| 30/09/2016 | Préstamos auto | AUTO ABS SPANISH LOANS 2016, FT | D | | | | | 4,00 | 4,30 | E 3 | 4,00 | 100,00 | 100,00 | D | 6.200.000 | | |
| 13/10/2016 | Préstamos hipotecarios | SRF 2016-1 | A | Aa2 | AAA | AAA | AAA | 1,80 | 3,80 | E 3 | 1,00 | 99,63 | 100,00 | C | 182.800.000 | | |
| 13/10/2016 | Préstamos hipotecarios | SRF 2016-1 | B | A2 | A | BBB | BBB | 1,80 | 5,10 | E 3 | 2,00 | 97,60 | 100,00 | C | 18.600.000 | | |
| 13/10/2016 | Préstamos hipotecarios | SRF 2016-1 | C | Baa2 | BBB | BBB | BBB | 1,80 | 5,10 | E 3 | 2,60 | 94,66 | 100,00 | C | 10.600.000 | | |
| 13/10/2016 | Préstamos hipotecarios | SRF 2016-1 | D | | | | | 1,80 | 5,10 | E 3 | 10,00 | 65,00 | 100,00 | D | 53.000.000 | | |
| 18/10/2016 | Préstamos hipotecarios | RMBS PRADO III | A | AA- | AAA | AAA | AAA | 2,00 | 3,76 | E 3 | 0,75 | 100,00 | 100,00 | C | 319.000.000 | | |
| 25/10/2016 | Otros | FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT | 28 | BBB+ | Baa2 | BBB+ | BBB+ | 0,76 | 99,92 | | 0,76 | 99,92 | 100,00 | C | 188.000.000 | | |
| 25/10/2016 | Otros | FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT | 24 | BBB+ | | | | 0,09 | 101,91 | | 0,09 | 101,91 | 100,00 | C | 186.000.000 | | |
| 25/10/2016 | Otros | FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT | 25 | BBB+ | | | | 0,20 | 99,65 | | 0,20 | 99,65 | 100,00 | C | 320.000.000 | | |
| 25/10/2016 | Otros | FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT | 26 | BBB+ | | | | 1,08 | 99,23 | | 1,08 | 99,23 | 100,00 | C | 200.000.000 | | |
| 25/10/2016 | Otros | FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT | 9 | BBB+ | A(Low) | A(Low) | A(Low) | 0,85 | 147,32 | | 0,85 | 147,32 | 100,00 | C | 65.000.000 | | |
| 08/11/2016 | Otros | FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT | 27 | BBB+ | Baa2 | BBB+ | BBB+ | - | 0,01 | 100,44 | | 0,01 | 100,44 | C | 70.000.000 | | |
| 17/11/2016 | Préstamos hipotecarios | BBVA RMBS 17 | Aa2 | Aa2 | AAA | AAA | AAA | 3,00 | 10,21 | E 3 | 0,30 | 100,00 | 100,00 | D | 1.584.000.000 | | |
| 22/11/2016 | PYMES | CAIXABANK PYMES 8 | A | A1 | BBB+ | BBB+ | BBB+ | 4,00 | 2,41 | E 3 | 1,25 | 100,00 | 100,00 | D | 1.957.500.000 | | |
| 22/11/2016 | PYMES | CAIXABANK PYMES 8 | B | Caa2 | | | | 4,00 | 5,63 | E 3 | 1,50 | 100,00 | 100,00 | D | 292.500.000 | | |
| 29/11/2016 | Préstamos empresas | IM GBP EMPRESAS VII | B | Caa2 | | | | 10,00 | 4,47 | E 3 | 0,50 | 100,00 | 100,00 | D | 675.000.000 | | |
| 29/11/2016 | Préstamos empresas | IM GBP EMPRESAS VII | A | A3 | | | | 10,00 | 2,98 | E 3 | 0,40 | 100,00 | 100,00 | D | 1.825.000.000 | | |

Importes en euros

| Fecha de registro | Activo titulado | Emisor | Serie | | | Rating | | TACP ¹ prevista media | Vida media (años) | Tipo de interés de referencia ² | Spread ³ | Precio (%) | | Inversores ⁴ | Importe |
|-------------------|------------------------|--------------------------------------|-------|---------|-------|--------|-------|--|-------------------------|--|---------------------|------------|-----------|-------------------------|---------------|
| | | | S&P | Moody's | Fitch | DBRS | Scope | | | | | Emisión | Reembolso | | |
| 02/12/2016 | Préstamos consumo | FTA SANTANDER CONSUMO 2 | A | AA | Aa2 | | | 10,00 | 3,54 | | 0,60 | 100,00 | 100,00 | D | 865.000.000 |
| 02/12/2016 | Préstamos consumo | FTA SANTANDER CONSUMO 2 | B | A | A3 | | | 10,00 | 5,84 | | 2,00 | 100,00 | 100,00 | D | 50.000.000 |
| 02/12/2016 | Préstamos consumo | FTA SANTANDER CONSUMO 2 | C | BBB | Baa3 | | | 10,00 | 6,20 | | 3,20 | 100,00 | 100,00 | D | 50.000.000 |
| 02/12/2016 | Préstamos consumo | FTA SANTANDER CONSUMO 2 | D | BB | Ba2 | | | 10,00 | 9,01 | | 6,50 | 100,00 | 100,00 | C | 20.000.000 |
| 02/12/2016 | Préstamos consumo | FTA SANTANDER CONSUMO 2 | E | BB | Ba3 | | | 10,00 | 11,15 | | 6,75 | 100,00 | 100,00 | C | 15.000.000 |
| 02/12/2016 | Préstamos consumo | FTA SANTANDER CONSUMO 2 | F | B | B3 | | | 10,00 | 1,37 | | 6,93 | 100,00 | 100,00 | C | 15.000.000 |
| 02/12/2016 | Préstamos auto | SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2 | A | AA | Aa2 | AA | | 5,00 | 6,09 | | 0,90 | 100,00 | 100,00 | C | 552.400.000 |
| 02/12/2016 | Préstamos auto | SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2 | B | A+ | A2 | A+ | | 5,00 | 8,75 | | 2,10 | 100,00 | 100,00 | D | 26.000.000 |
| 02/12/2016 | Préstamos auto | SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2 | C | BBB | Baa1 | BBB | | 5,00 | 9,29 | | 3,10 | 100,00 | 100,00 | D | 35.800.000 |
| 02/12/2016 | Préstamos auto | SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2 | D | BB+ | Baa3 | BB+ | | 5,00 | 9,33 | | 5,10 | 100,00 | 100,00 | D | 19.500.000 |
| 02/12/2016 | Préstamos auto | SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2 | E | BB- | Ba1 | BB- | | 5,00 | 9,33 | | 6,30 | 100,00 | 100,00 | D | 16.300.000 |
| 02/12/2016 | Préstamos auto | SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2 | F | | | | | 5,00 | 9,33 | | 11,00 | 100,00 | 100,00 | D | 13.000.000 |
| 12/01/2017 | Otros | FTA SANTANDER 2 ⁵ | | A2 | F2 | | | | | | | | | | 3.000.000.000 |
| 17/02/2017 | Otros | FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT | 29 | BBB+ | Baa2 | BBB+ | A | | | | 0,69 | 99,68 | 100,00 | C | 1.000.000.000 |
| 02/03/2017 | Otros | FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT | 30 | BBB+ | Baa2 | BBB+ | A | | | | 0,16 | 99,91 | 100,00 | C | 130.000.000 |
| 21/03/2017 | Préstamos hipotecarios | CAIXABANK RMBS 2 | A | Aa3 | Aa3 | A(Low) | | 3,00 | 7,52 | E 3 | 0,50 | 100,00 | 100,00 | D | 2.448.000.000 |
| 21/03/2017 | Préstamos hipotecarios | CAIXABANK RMBS 2 | B | Caa1 | B | | | 3,00 | 16,30 | E 3 | 0,65 | 100,00 | 100,00 | D | 272.000.000 |
| 23/03/2017 | Préstamos consumo | BBVA CONSUMO 9 | A | A3 | A3 | A | AA- | 11,00 | 2,23 | | 0,70 | 100,00 | 100,00 | D | 1.251.200.000 |
| 23/03/2017 | Préstamos consumo | BBVA CONSUMO 9 | B | | B- | BB | B- | 11,00 | 5,48 | | 1,00 | 100,00 | 100,00 | D | 123.800.000 |
| 28/03/2017 | Préstamos hipotecarios | SRF 2017-1 | A | Aa2 | Aa+ | AAA | | 1,80 | 3,80 | E 3 | 0,90 | 100,00 | 100,00 | C | 248.000.000 |
| 28/03/2017 | Préstamos hipotecarios | SRF 2017-1 | B | A2 | A | | | 1,80 | 5,10 | M 3 | 1,90 | 100,00 | 100,00 | C | 40.000.000 |
| 28/03/2017 | Préstamos hipotecarios | SRF 2017-1 | C | Baa3 | | BBB | | 1,80 | 5,10 | E 3 | 2,50 | 98,08 | 100,00 | C | 16.000.000 |
| 28/03/2017 | Préstamos hipotecarios | SRF 2017-1 | D | Ba2 | | BB | | 1,80 | 5,10 | E 3 | 2,60 | 92,81 | 100,00 | C | 12.000.000 |
| 28/03/2017 | Préstamos hipotecarios | SRF 2017-1 | E | | | | | 1,80 | | E 3 | 10,00 | 65,00 | 100,00 | D | 84.000.000 |
| 28/03/2017 | Préstamos consumo | IM GRUPO BANCO POPULAR CONSUMO I | A | A2 | A | | | 6,00 | 3,07 | E 3 | 0,40 | 100,00 | 100,00 | D | 423.300.000 |
| 28/03/2017 | Préstamos consumo | IM GRUPO BANCO POPULAR CONSUMO I | B | Caa2 | | CC | | 6,00 | 4,39 | E 3 | 0,50 | 100,00 | 100,00 | D | 86.700.000 |
| 30/03/2017 | Préstamos hipotecarios | RMBS PRADO IV | A | AA+ | AAA | | | 5,00 | 4,01 | M 3 | 0,60 | 100,00 | 100,00 | C | 305.000.000 |
| 30/03/2017 | Préstamos hipotecarios | RMBS PRADO IV | B | | | | | 5,00 | 5,19 | M 3 | 1,20 | 100,00 | 100,00 | D | 85.000.000 |
| 06/04/2017 | Otros | COLUMBUS MASTER CREDIT ⁶ | | | | | | | | | | | | | 2.000.000.000 |
| 20/04/2017 | Otros | COLUMBUS MASTER CREDIT | A | AA+ | AA | | | | | | 0,25 | 100,00 | 100,00 | C | 470.000.000 |
| 20/04/2017 | Otros | COLUMBUS MASTER CREDIT | C | | | | | | | | 0,50 | 100,00 | 100,00 | C | 110.000.000 |

(1) Tasa anual constante de prepago media prevista.

(2) Tipo de interés de referencia (E - Euribor, C - CECA, L - Libor, M - Mibor, O - Otros) y plazo en meses.

(3) Margen en porcentaje en el caso de valores indicados: tipo de interés en el caso de valores con tipo de interés fijo.

(4) Tipo de inversor que suscribe la serie: P - privado, C - cualificado, M - minorista, D - Cedente y E - emisor.

(5) Renovación del programa de pagarés. El importe se refiere al saldo nominal vivo máximo por lo que no se incluye en los cuadros del capítulo 1.

(6) Inicio de programa de emisión de bonos de titulización. El importe se refiere al saldo nominal vivo máximo por lo que no se incluye en los cuadros del capítulo 1.