



Estadísticas sobre la información económica y financiera de los Fondos
de titulización de activos
Ejercicio 2022

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
-

NOTA: A partir de 2018 la información pasa a tener periodicidad anual.

Miles de euros	31/12/2022					31/12/2021					
	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	% VARIACIÓN TOTAL FONDOS
ACTIVO											
A) ACTIVO NO CORRIENTE	119.636.004	-	119.636.004	3.785.340	123.421.344	121.118.699	-	121.118.699	3.358.492	124.477.191	-0,85
I. Activos financieros a largo plazo	119.636.004	-	119.636.004	3.783.820	123.419.824	121.118.699	-	121.118.699	3.356.420	124.475.119	-0,85
1. Activos titulizados	117.983.123	-	117.983.123	3.504.887	121.488.010	120.922.623	-	120.922.623	3.322.458	124.245.081	-2,22
1.1 Participaciones hipotecarias	15.842.778	-	15.842.778	4.690	15.847.468	10.312.297	-	10.312.297	22.761	10.335.058	53,34
1.2 Certificados de transmisión de hipoteca	67.182.373	-	67.182.373	198.233	67.380.606	68.468.478	-	68.468.478	271.902	68.740.380	-1,98
1.3 Préstamos hipotecarios	99.968	-	99.968	0	99.968	113.089	-	113.089	0	113.089	-11,60
1.4 Cédulas hipotecarias	11.660.000	-	11.660.000	0	11.660.000	13.260.000	-	13.260.000	0	13.260.000	-12,07
1.5 Préstamos a promotores	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.6 Préstamos a PYMES	4.317.045	-	4.317.045	62.349	4.379.394	6.673.593	-	6.673.593	500	6.674.093	-34,38
1.7 Préstamos a empresas	18.019	-	18.019	472.950	490.969	23.079	-	23.079	389.282	412.361	19,06
1.8 Préstamos corporativos	0	-	0	368.218	368.218	0	-	0	597.608	597.608	-38,38
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	19.753	19.753	0	-	0	29.629	29.629	-33,33
1.13 Préstamos consumo	5.242.236	-	5.242.236	403.032	5.645.268	7.100.801	-	7.100.801	361.833	7.462.634	-24,35
1.14 Préstamos automoción	5.392.343	-	5.392.343	0	5.392.343	4.227.574	-	4.227.574	0	4.227.574	27,55
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	695.525	-	695.525	0	695.525	1.162.595	-	1.162.595	0	1.162.595	-40,17
1.16 Cuentas a cobrar	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.17 Derechos de crédito futuros	0	-	0	289.794	289.794	0	-	0	320.020	320.020	-9,45
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	6.593.350	-	6.593.350	519.973	7.113.323	8.462.838	-	8.462.838	54.938	8.517.776	-16,49
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0	-	0	2.928	2.928	0	-	0	1.401	1.401	108,99
1.22 Activos dudosos -principal-	1.205.691	-	1.205.691	1.380.404	2.586.095	1.413.770	-	1.413.770	1.323.274	2.737.044	-5,52
1.23 Activos dudosos -intereses-	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	-266.204	-	-266.204	-217.436	-483.640	-295.490	-	-295.490	-50.688	-346.178	39,71
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2. Derivados	1.567.803	-	1.567.803	5.588	1.573.391	126.088	-	126.088	0	126.088	1.147,85
2.1 Derivados de cobertura	1.207.811	-	1.207.811	5.588	1.213.399	126.088	-	126.088	0	126.088	862,34
2.2 Derivados de negociación	359.992	-	359.992	0	359.992	0	-	0	0	0	-
3. Otros activos financieros	85.078	-	85.078	273.344	358.422	69.988	-	69.988	33.962	103.950	244,80
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	125	-	125	0	125	-4,00
3.4 Otros	84.958	-	84.958	273.344	358.302	69.863	-	69.863	33.962	103.825	245,10
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	1.521	1.521	0	-	0	2.072	2.072	-26,59

	31/12/2022					31/12/2021					
Miles de euros	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	% VARIACIÓN TOTAL FONDOS
B) ACTIVO CORRIENTE	32.447.346	-	32.447.346	3.014.019	35.461.365	30.370.830	-	30.370.830	3.641.114	34.011.944	4,26
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	416.799	-	416.799	0	416.799	513.532	-	513.532	0	513.532	-18,84
V. Activos financieros a corto plazo	22.506.845	-	22.506.845	1.848.573	24.355.418	20.907.489	-	20.907.489	1.601.615	22.509.104	8,20
1. Activos titulizados	20.829.584	-	20.829.584	1.779.483	22.609.067	19.893.311	-	19.893.311	1.561.714	21.455.025	5,38
1.1 Participaciones hipotecarias	1.651.354	-	1.651.354	8.246	1.659.600	1.133.931	-	1.133.931	20.760	1.154.691	43,73
1.2 Certificados de transmisión de hipoteca	4.968.799	-	4.968.799	157.798	5.126.597	4.466.577	-	4.466.577	50.616	4.517.193	13,49
1.3 Préstamos hipotecarios	11.972	-	11.972	0	11.972	14.808	-	14.808	0	14.808	-19,15
1.4 Cédulas hipotecarias	1.600.000	-	1.600.000	0	1.600.000	1.400.000	-	1.400.000	0	1.400.000	14,29
1.5 Préstamos a promotores	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.6 Préstamos a PYMES	2.535.825	-	2.535.825	12.627	2.548.452	2.401.852	-	2.401.852	0	2.401.852	6,10
1.7 Préstamos a empresas	3.890	-	3.890	1.454	5.344	4.556	-	4.556	0	4.556	17,30
1.8 Préstamos corporativos	0	-	0	324.654	324.654	0	-	0	556.080	556.080	-41,62
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	3.667.780	-	3.667.780	134.458	3.802.238	4.428.871	-	4.428.871	101.068	4.529.939	-16,06
1.14 Préstamos automoción	3.048.549	-	3.048.549	0	3.048.549	2.457.330	-	2.457.330	0	2.457.330	24,06
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	405.959	-	405.959	0	405.959	655.927	-	655.927	0	655.927	-38,11
1.16 Cuentas a cobrar	0	-	0	39.483	39.483	0	-	0	3.685	3.685	971,45
1.17 Derechos de crédito futuros	0	-	0	30.665	30.665	0	-	0	29.306	29.306	4,64
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	1.867.327	-	1.867.327	352.207	2.219.534	1.837.972	-	1.837.972	336.079	2.174.051	2,09
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	480.006	-	480.006	9.182	489.188	455.903	-	455.903	6.260	462.163	5,85
1.22 Intereses vencidos e impagados	12.827	-	12.827	467	13.294	8.351	-	8.351	355	8.706	52,70
1.23 Activos dudosos -principal-	1.031.599	-	1.031.599	752.775	1.784.374	1.111.392	-	1.111.392	476.145	1.587.537	12,40
1.24 Activos dudosos -intereses-	34.859	-	34.859	6.040	40.899	52.621	-	52.621	4.604	57.225	-28,53
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	-491.162	-	-491.162	-60.449	-551.611	-536.779	-	-536.779	-33.122	-569.901	-3,21
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2. Derivados	452.568	-	452.568	0	452.568	4.462	-	4.462	2	4.464	-
2.1 Derivados de cobertura	452.568	-	452.568	0	452.568	4.462	-	4.462	2	4.464	-
2.2 Derivados de negociación	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
3. Otros activos financieros	1.224.693	-	1.224.693	69.090	1.293.783	1.009.715	-	1.009.715	39.899	1.049.614	23,26
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	1.200.390	-	1.200.390	8.790	1.209.180	985.676	-	985.676	6.503	992.179	21,87
3.4 Garantías financieras	3	-	3	0	3	0	-	0	0	0	-
3.5 Otros	24.300	-	24.300	60.299	84.599	24.038	-	24.038	33.396	57.434	47,30
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
VI. Ajustes por periodificaciones	5.029	-	5.029	7.794	12.823	1.147	-	1.147	7.793	8.940	43,43
1. Comisiones	158	-	158	0	158	130	-	130	0	130	21,54
2. Otros	4.871	-	4.871	7.794	12.665	1.017	-	1.017	7.793	8.810	43,76
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	9.518.672	-	9.518.672	1.157.652	10.676.324	8.948.662	-	8.948.662	2.031.704	10.980.366	-2,77
1. Tesorería	9.518.672	-	9.518.672	1.157.652	10.676.324	8.948.662	-	8.948.662	2.031.704	10.980.366	-2,77
2. Otros activos líquidos equivalentes	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
TOTAL ACTIVO	152.083.350	-	152.083.350	6.799.359	158.882.709	151.489.529	-	151.489.529	6.999.606	158.489.135	0,25

	31/12/2022					31/12/2021					
	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	% VARIACIÓN TOTAL FONDOS
Miles de euros											
PASIVO											-
A) PASIVO NO CORRIENTE	126.826.149	-	126.826.149	4.919.718	131.745.867	131.545.473	-	131.545.473	5.400.634	136.946.107	-3,80
I. Provisiones a largo plazo	944.837	-	944.837	61.492	1.006.329	860.954	-	860.954	21.397	882.351	14,05
1. Provisión garantías financieras	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2. Provisión por margen de intermediación	944.837	-	944.837	61.492	1.006.329	860.954	-	860.954	21.397	882.351	14,05
3. Otras provisiones	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
II. Pasivos financieros a largo plazo	125.881.312	-	125.881.312	4.858.226	130.739.538	130.684.518	-	130.684.518	5.379.236	136.063.754	-3,91
1. Obligaciones y otros valores emitidos	119.511.226	-	119.511.226	4.449.340	123.960.566	123.339.581	-	123.339.581	5.205.872	128.545.453	-3,57
1.1 Series no subordinadas	93.001.214	-	93.001.214	4.535.756	97.536.970	94.649.494	-	94.649.494	4.985.551	99.635.045	-2,11
1.2 Series subordinadas	27.196.767	-	27.196.767	836.992	28.033.759	29.384.264	-	29.384.264	822.723	30.206.987	-7,19
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	-686.755	-	-686.755	-923.408	-1.610.163	-694.178	-	-694.178	-602.402	-1.296.580	24,19
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	6.138.955	-	6.138.955	125.438	6.264.393	6.800.859	-	6.800.859	125.486	6.926.345	-9,56
2.1 Préstamo subordinado	6.191.855	-	6.191.855	124.161	6.316.016	6.290.945	-	6.290.945	123.373	6.414.318	-1,53
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	263.749	-	263.749	1.427	265.176	745.317	-	745.317	2.112	747.429	-64,52
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	462.500	-	462.500	0	462.500	482.174	-	482.174	0	482.174	-4,08
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	-779.149	-	-779.149	-150	-779.299	-717.577	-	-717.577	0	-717.577	8,60
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
3. Derivados	115.251	-	115.251	0	115.251	456.559	-	456.559	262	456.821	-74,77
3.1 Derivados de cobertura	115.251	-	115.251	0	115.251	456.559	-	456.559	262	456.821	-74,77
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	115.880	-	115.880	283.448	399.328	87.520	-	87.520	47.616	135.136	195,50
4.1 Garantías financieras	16.837	-	16.837	93.291	110.128	12.373	-	12.373	45.404	57.777	90,61
4.1 Otros	99.043	-	99.043	191.434	290.477	75.147	-	75.147	3.063	78.210	271,41
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0	-	0	-1.277	-1.277	0	-	0	-850	-850	50,24
III. Pasivos por impuesto diferido	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-

	31/12/2022					31/12/2021					
	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	% VARIACIÓN TOTAL FONDOS
Miles de euros											
B) PASIVO CORRIENTE	23.401.786	-	23.401.786	1.874.052	25.275.838	20.371.194	-	20.371.194	1.599.234	21.970.428	15,04
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	182	-	182	0	182	0	-	0	0	0	-
V. Provisiones a corto plazo	545	-	545	0	545	545	-	545	0	545	0,00
1. Provisión garantías financieras	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2. Provisión por margen de intermediación	545	-	545	0	545	545	-	545	0	545	0,00
3. Otras provisiones	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
VI. Pasivos financieros a corto plazo	22.822.879	-	22.822.879	1.814.487	24.637.366	19.732.896	-	19.732.896	1.555.903	21.288.799	15,73
1. Obligaciones y otros valores emitidos	21.730.081	-	21.730.081	1.585.477	23.315.558	18.713.044	-	18.713.044	1.340.902	20.053.946	16,26
1.1 Series no subordinadas	18.219.261	-	18.219.261	1.604.561	19.823.822	16.834.379	-	16.834.379	1.263.208	18.097.587	9,54
1.2 Series subordinadas	2.722.495	-	2.722.495	0	2.722.495	1.266.717	-	1.266.717	0	1.266.717	114,93
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	-108.150	-	-108.150	-1.741.730	-1.849.880	-99.958	-	-99.958	-1.628.845	-1.728.803	7,00
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	615.917	-	615.917	25.898	641.815	446.752	-	446.752	21.382	468.134	37,10
1.5 Intereses vencidos e impagados	280.557	-	280.557	1.696.748	1.977.305	265.153	-	265.153	1.685.157	1.950.310	1,38
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2. Deudas con entidades de crédito	690.668	-	690.668	3.282	693.950	574.783	-	574.783	5.984	580.767	19,49
2.1 Préstamo subordinado	590.390	-	590.390	1.616	592.006	396.083	-	396.083	1.149	397.232	49,03
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	24.356	-	24.356	80	24.436	28.700	-	28.700	96	28.796	-15,14
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	54.660	-	54.660	774	55.434	143.486	-	143.486	3.267	146.753	-62,23
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	-345.994	-	-345.994	-1.021	-347.015	-337.512	-	-337.512	-409	-337.921	2,69
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	23.068	-	23.068	1.765	24.833	10.794	-	10.794	1.860	12.654	96,25
2.6 Intereses vencidos e impagados	344.189	-	344.189	67	344.256	333.232	-	333.232	22	333.254	3,30
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
3. Derivados	10.725	-	10.725	2.915	13.640	114.986	-	114.986	1.399	116.385	-88,28
3.1 Derivados de cobertura	10.725	-	10.725	2.915	13.640	114.986	-	114.986	1.399	116.385	-88,28
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	391.406	-	391.406	222.814	614.220	330.081	-	330.081	207.617	537.698	14,23
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	281.751	-	281.751	161.289	443.040	230.480	-	230.480	166.017	396.497	11,74
4.2 Garantías financieras	0	-	0	57.772	57.772	0	-	0	33.033	33.033	74,89
4.3 Otros	109.655	-	109.655	3.753	113.408	99.601	-	99.601	8.567	108.168	4,84
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
VII. Ajustes por periodificaciones	578.180	-	578.180	59.567	637.747	637.753	-	637.753	43.332	681.085	-6,36
1. Comisiones	530.147	-	530.147	16.146	546.293	602.483	-	602.483	6.386	608.869	-10,28
1.1 Comisión sociedad gestora	1.899	-	1.899	412	2.311	2.063	-	2.063	203	2.266	1,99
1.2 Comisión administrador	26.869	-	26.869	478	27.347	26.048	-	26.048	1.721	27.769	-1,52
1.3 Comisión agente financiero/pagos	285	-	285	36	321	269	-	269	40	309	3,88
1.4 Comisión variable	831.682	-	831.682	15.240	846.922	896.901	-	896.901	4.742	901.643	-6,07
1.5 Otras comisiones del cedente	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	-330.980	-	-330.980	-394	-331.374	-323.200	-	-323.200	-453	-323.653	2,39
1.7 Otras comisiones	391	-	391	374	765	402	-	402	131	533	43,53
2. Otros	48.032	-	48.032	43.420	91.452	35.270	-	35.270	36.947	72.217	26,64
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	1.855.414	-	1.855.414	5.588	1.861.002	-427.136	-	-427.136	-262	-427.398	-
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
IX. Coberturas de flujos de efectivo	1.855.414	-	1.855.414	5.588	1.861.002	-427.136	-	-427.136	-262	-427.398	-
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
TOTAL PASIVO	152.083.350	-	152.083.350	6.799.359	158.882.709	151.489.529	-	151.489.529	6.999.606	158.489.135	0,25

Cuenta de pérdidas y ganancias agregada

CUADRO B

	BONOS/ F. PÚBLICOS			PAGARÉS/ F. PÚBLICOS			F. PRIVADOS			TOTAL		
Miles de euros	2022	2021	%	2022	2021	%	2022	2021	%	2022	2021	%
1. Intereses y rendimientos asimilados	3.233.160	3.248.034	-0,46	-	-	-	324.372	371.507	-12,69	3.557.532	3.619.541	-1,71
1.1 Activos titulizados	3.161.521	3.226.078	-2,00	-	-	-	273.490	333.880	-18,09	3.435.011	3.559.958	-3,51
1.2 Otros activos financieros	71.639	21.956	226,28	-	-	-	50.882	37.627	35,23	122.521	59.583	105,63
2. Intereses y cargas asimilados	-1.641.361	-1.266.766	29,57	-	-	-	-406.970	-453.984	-10,36	-2.048.331	-1.720.750	19,04
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	-1.479.519	-1.083.049	36,61	-	-	-	-398.618	-450.875	-11,59	-1.878.137	-1.533.924	22,44
2.2 Deudas con entidades de crédito	-138.519	-120.629	14,83	-	-	-	-6.269	-1.907	228,74	-144.788	-122.536	18,16
2.3 Otros pasivos financieros	-23.323	-63.088	-63,03	-	-	-	-2.081	-1.201	73,27	-25.404	-64.289	-60,48
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	5.849	-138.347	-	-	-	-	-916	-212	-332,08	4.933	-138.559	-
A) MARGEN DE INTERESES	1.597.649	1.842.921	-13,31	-	-	-	-83.513	-82.688	-1,00	1.514.136	1.760.233	-13,98
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	-12.197	-24.345	49,90	-	-	-	95	0	-	-12.102	-24.345	50,29
4.1 Resultados de derivados de negociación	0	0	-	-	-	-	0	0	-	0	-	-
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0	0	-	-	-	-	0	0	-	0	-	-
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0	0	-	-	-	-	0	0	-	0	-	-
4.4 Otros	-12.197	-24.345	49,90	-	-	-	95	0	-	-12.102	-24.345	50,29
5. Diferencias de cambio (neto)	0	0	-	-	-	-	0	5	-100,00	0	5	-100,00
6. Otros ingresos de explotación	5.711	4.257	34,16	-	-	-	3.753	3.659	2,57	9.464	7.916	19,56
7. Otros gastos de explotación	-1.583.082	-1.618.373	-2,18	-	-	-	-102.805	-74.951	37,16	-1.685.887	-1.693.324	-0,44
7.1 Servicios exteriores	-25.010	-27.459	-8,92	-	-	-	-18.283	-18.775	-2,62	-43.293	-46.234	-6,36
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	-19.439	-22.211	-12,48	-	-	-	-11.358	-16.412	-30,79	-30.797	-38.623	-20,26
7.1.2 Servicios bancarios y similares	-1.821	-1.664	9,44	-	-	-	-929	-660	40,76	-2.750	-2.324	18,33
7.1.3 Publicidad y propaganda	-1	-1	0,00	-	-	-	0	0	-	-1	-1	0,00
7.1.4 Otros servicios	-3.748	-3.584	4,58	-	-	-	-5.996	-1.703	252,08	-9.744	-5.287	84,30
7.2 Tributos	-393	-301	30,56	-	-	-	-31	-20	55,00	-424	-321	32,09
7.3 Otros gastos de gestión corriente	-1.557.679	-1.590.612	-2,07	-	-	-	-84.492	-56.157	50,46	-1.642.171	-1.646.769	-0,28
7.3.1 Comisión sociedad gestora	-20.305	-20.178	0,63	-	-	-	-5.878	-3.717	58,14	-26.183	-23.895	9,58
7.3.2 Comisión administrador	-38.234	-43.200	-11,50	-	-	-	-31.155	-28.630	8,82	-69.389	-71.830	-3,40
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	-3.253	-3.184	2,17	-	-	-	-918	-560	63,93	-4.171	-3.744	11,40
7.3.4 Comisión variable	-1.486.636	-1.509.565	-1,52	-	-	-	-43.576	-21.539	102,31	-1.530.212	-1.531.104	-0,06
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0	0	-	-	-	-	0	-5	-100,00	0	-5	-100,00
7.3.6 Otros gastos	-9.252	-14.485	-36,13	-	-	-	-2.964	-1.707	73,64	-12.216	-16.192	-24,56
8. Deterioro de activos financieros (neto)	-40.141	-210.158	80,90	-	-	-	-212.886	-15.976	-	-253.027	-226.134	-11,89
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	-40.335	-210.158	80,81	-	-	-	-212.886	-15.976	-	-253.221	-226.134	-11,98
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	194	0	-	-	-	-	0	0	-	194	-	-
9. Dotaciones a provisiones (neto)	-84.086	-51.234	-64,12	-	-	-	-40.095	-21.039	-90,57	-124.181	-72.273	-71,82
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0	0	-	-	-	-	0	0	-	0	-	-
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	-83.882	-53.065	-58,07	-	-	-	-40.095	-21.039	-90,57	-123.977	-74.104	-67,30
9.3 Dotación otras provisiones	-204	1.831	-	-	-	-	0	0	-	-204	1.831	-
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	65.734	-17.761	-	-	-	-	0	0	-	65.734	-17.761	-
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	50.411	74.693	-32,51	-	-	-	435.452	190.992	127,99	485.863	265.685	82,87
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0	0	-	-	-	-	0	0	-	0	0	-
12. Impuesto sobre beneficios	0	0	-	-	-	-	0	0	-	0	0	-
C) RESULTADO DEL PERIODO	0	0	-	-	-	-	0	0	-	0	0	-

Estado de flujos de efectivo agregado

CUADRO C

	BONOS/ F. PÚBLICOS			PAGARÉS/ F. PÚBLICOS			F. PRIVADOS			TOTAL		
Miles de euros	2022	2021	%	2022	2021	%	2022	2021	%	2022	2021	%
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	-609.505	-1.605.353	62,03	-	-	-	-313.354	-352.044	10,99	-922.859	-1.957.397	52,85
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	1.644.029	1.786.406	-7,97	-	-	-	-276.243	-324.292	14,82	1.367.786	1.462.114	-6,45
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	3.128.888	3.404.985	-8,11	-	-	-	109.666	170.998	-35,87	3.238.554	3.575.983	-9,44
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	-1.294.819	-1.328.848	-2,56	-	-	-	-380.276	-493.620	-22,96	-1.675.095	-1.822.468	-8,09
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	190.281	64.074	196,97	-	-	-	622	584	6,51	190.903	64.658	195,25
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	-271.497	-213.736	27,02	-	-	-	-20	0	-	-271.517	-213.736	27,03
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	4.411	514	758,17	-	-	-	0	0	-	4.411	514	758,17
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	-117.074	-129.221	-9,40	-	-	-	-6.417	-252	-	-123.491	-129.473	-4,62
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	3.841	-11.361	-	-	-	-	181	-2.001	-	4.022	-13.362	-
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	-1.647.632	-1.755.204	-6,13	-	-	-	-72.960	-53.779	35,67	-1.720.592	-1.808.983	-4,89
2.1 Comisión sociedad gestora	-20.395	-20.599	-0,99	-	-	-	-5.749	-3.724	54,38	-26.144	-24.323	7,49
2.2 Comisión administrador	-37.407	-41.693	-10,28	-	-	-	-32.417	-27.535	17,73	-69.824	-69.228	0,86
2.3 Comisión agente financiero/pagos	-3.237	-3.164	2,31	-	-	-	-1.247	-537	132,22	-4.484	-3.701	21,16
2.4 Comisión variable	-1.582.332	-1.683.837	-6,03	-	-	-	-31.804	-18.820	68,99	-1.614.136	-1.702.657	-5,20
2.5 Otras comisiones	-4.261	-5.910	-27,90	-	-	-	-1.745	-3.164	-44,85	-6.006	-9.074	-33,81
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	-605.904	-1.636.556	62,98	-	-	-	35.850	26.026	37,75	-570.054	-1.610.530	64,60
3.1 Pagos por garantías financieras	-1.560	0	-	-	-	-	-3.769	0	-	-5.329	0	-
3.2 Cobros por garantías financieras	3.124	741	321,59	-	-	-	40.798	33.383	22,21	43.922	34.124	28,71
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	-2.249	-1.370	64,16	-	-	-	0	0	-	-2.249	-1.370	64,16
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	3.588	813	341,33	-	-	-	0	0	-	3.588	813	341,33
3.5 Otros pagos de explotación	-3.696.856	-5.131.432	-27,96	-	-	-	-101.631	-70.091	45,00	-3.798.487	-5.201.523	-26,97
3.6 Otros cobros de explotación	3.088.049	3.494.692	-11,64	-	-	-	100.452	62.734	60,12	3.188.501	3.557.426	-10,37
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	1.179.516	36.284	-	-	-	-	-560.696	1.665.288	-	618.820	1.701.572	-63,63
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	20.647.313	17.939.599	15,09	-	-	-	2.799.332	3.833.040	-26,97	23.446.645	21.772.639	7,69
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	-25.472.055	-23.568.770	8,08	-	-	-	-3.974.211	-4.488.477	-11,46	-29.446.266	-28.057.247	4,95
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	6.396.524	5.252.902	21,77	-	-	-	619.368	2.191.476	-71,74	7.015.892	7.444.378	-5,76
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	17.489.924	19.464.384	-10,14	-	-	-	2.901.395	1.409.043	105,91	20.391.319	20.873.427	-2,31
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	9.583.460	9.773.640	-1,95	-	-	-	508.201	1.520.686	-66,58	10.091.661	11.294.326	-10,65
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	571.591	479.521	19,20	-	-	-	294.748	205.902	43,15	866.339	685.423	26,39
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	190.970	64.732	195,02	-	-	-	819	244	235,66	191.789	64.976	195,17
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	198.594	100.630	97,35	-	-	-	0	0	-	198.594	100.630	97,35
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	-21.638.014	-24.630.006	-12,15	-	-	-	-3.085.796	-944.400	226,75	-24.723.810	-25.574.406	-3,33
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	-392.267	412.553	-	-	-	-	-5.187	129.250	-	-397.454	541.803	-
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	2.434.468	2.822.064	-13,73	-	-	-	5.381	131.327	-95,90	2.439.849	2.953.391	-17,39
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	-2.828.608	-2.349.053	20,41	-	-	-	-3.180	-7.618	-58,26	-2.831.788	-2.356.671	20,16
7.3 Pagos a Administraciones públicas	-73	-146	-50,00	-	-	-	-628	-327	92,05	-701	-473	48,20
7.4 Otros cobros y pagos	1.947	-60.313	-	-	-	-	-6.758	5.868	-	-4.811	-54.445	-91,16
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	570.011	-1.569.070	-	-	-	-	-874.049	1.313.244	-	-304.038	-255.826	18,85
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8.948.662	10.517.732	-14,92	-	-	-	2.031.701	718.460	182,79	10.980.363	11.236.192	-2,28
Efectivo o equivalentes al final del periodo	9.518.672	8.948.662	6,37	-	-	-	1.157.652	2.031.704	-43,02	10.676.324	10.980.366	-2,77

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 titulación públicos - bonos										
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
sept-17	217.375.885	2,90	2,06	0,90	0,95	0,43	-1,30	9,24	3,78	1,38
Fondos de titulación públicos - bonos - sin titulación de cédulas										
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
sept-17	177.613.010	3,59	2,55	1,11	1,18	0,53	-1,59	11,40	4,65	1,32
Fondos de titulación públicos - pagarés										
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
sept-17	935.777	-	0,12	1,73	15,30	0,04	-0,52	-	7,86	100,00
Fondos de titulación privados										
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
sept-17	4.168.485	0,03	2,13	-	-	-	-23,16	-	-	9,23

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

** Se han excluido los datos del fondo de titulación 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	31/12/2022	91.217.258	6,58	56,93	1,69	1,66	7,66	20,01	11,14	1,19	0,54	30,66
	31/12/2021	86.120.917	3,54	57,31	2,03	1,83	3,57	20,26	10,64	0,75	0,57	32,30
Cédulas hipotecarias, territoriales y de internacionalización	31/12/2022	13.586.799	0,00	-	-	-	-	4,15	16,98	4,08	-	24,18
	31/12/2021	14.989.073	0,00	-	-	-	-	4,71	15,89	4,09	-	23,32
Préstamos a promotores	31/12/2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Préstamos a empresas, corporativos y PYMES	31/12/2022	6.991.848	4,59	36,74	2,44	2,51	11,12	6,00	5,65	2,51	7,74	14,41
	31/12/2021	9.235.711	6,56	39,21	1,95	1,85	6,15	5,87	4,79	1,90	6,52	11,91
Deduda subordinada y bonos de tesorería	31/12/2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAPP	31/12/2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Consumo y automoción	31/12/2022	17.479.176	10,55	0,61	2,29	2,09	4,60	3,82	3,44	7,27	0,22	22,62
	31/12/2021	18.386.484	11,46	0,86	2,59	1,73	2,26	3,93	3,44	7,64	0,27	23,31
Cuentas a cobrar y cuotas de leasing	31/12/2022	1.110.059	6,28	14,23	1,77	0,66	6,69	4,83	5,94	2,13	16,52	17,40
	31/12/2021	1.822.720	6,74	15,51	0,64	0,39	10,86	4,64	4,76	1,74	12,58	17,37
Derechos de crédito futuros	31/12/2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Bonos de titulación	31/12/2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Otros	31/12/2022	8.427.567	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,46	10,36	1,87	100,00	-
	31/12/2021	10.261.030	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	5,43	9,40	2,56	100,00	-
Pagarés	31/12/2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FONDOS PRIVADOS	31/12/2022	5.284.370	6,90	19,04	16,14	0,10	0,05	6,21	6,30	2,04	48,06	-
	31/12/2021	4.884.173	12,93	15,08	14,24	0,10	0,02	6,69	6,30	1,28	53,11	-

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	PRESTAMOS 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-22	130	4	0	18	0	0	34	3	0	0	1	0	53	243
dic-21	143	6	0	19	0	0	28	3	0	0	1	0	40	240
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
sep.-17	197	12	0	37	0	0	22	3	0	0	2	1	20	295

* 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	210.757
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO MARE NOSTRUM	59.131
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	AHORRO CORPORACIÓN FINANCIERA	3.272.424
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	AHORRO CORPORACIÓN FINANCIERA	2.081.000
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	MULTICEDENTE	1.170.443
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	1.360.594
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	462.163
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	509.432
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	KUTXABANK	183.033
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	KUTXABANK	212.291
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	MULTICEDENTE	270
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	MULTICEDENTE	97.379
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	KUTXABANK	50.221
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	KUTXABANK	151.791
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	KUTXABANK	310.807
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO POPULAR ESPAÑOL	6.330
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO POPULAR ESPAÑOL	126.557
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	ABANCA CORPORACION BANCARIA	632.929
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	ABANCA CORPORACION BANCARIA	658.354
CAIXABANK CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	192.196
CAIXABANK CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	277.545
CAIXABANK CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	141.282
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	1.236.102
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	448.675
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	936.774
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	1.101.793
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	1.413.681
CAIXABANK PYMES 8, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	456.310
CAIXABANK PYMES 9, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	283.428
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	8.808.152
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	1.846.433
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	1.603.837
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	136.824
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	101.482
BANCAJA 10, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	619.864
BANCAJA 11, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	577.252
BANCAJA 13, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	1.276.405
BANCAJA 8, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	208.155
BANCAJA 9, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	317.864
BANKINTER 10, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANKINTER	221.547
BANKINTER 13 FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANKINTER	333.857
BANKINTER 9, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANKINTER	125.586
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	226.891
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	906.376
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	896.151
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.426.034
BBVA CONSUMO 9, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	267.166
BBVA LEASING 1, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	3.954
BBVA LEASING 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	846.771
BBVA RMBS 1, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	653.659
BBVA RMBS 14, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	350.666
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.157.467
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.625.982
BBVA RMBS 2, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.213.410
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	2.613.326
BBVA RMBS 3, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.069.838
BBVA RMBS 5 FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.914.668
BBVA RMBS 9, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	668.123
BBVA-6 FTPYME FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	8.174
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO SANTANDER	8.967
HIPOCAT 10, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	179.065
HIPOCAT 11, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	194.957
HIPOCAT 8, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	171.898

FONDO		TIPO		GESTORA	CEDENTE	TOTAL ACTIVO (1)
HIPOCAT 9, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	129.193
MBS BANCAJA 3, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	98.344
MBS BANCAJA 4, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	303.853
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	108.030
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	279.254
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	160.760
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	399.537
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	525.228
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	286.653
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAJA RURAL DE ARAGON, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	90.461
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	250.484
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	64.524
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	50.411
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	182.318
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	219.586
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	136.311
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO CETELEM	421.296
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO CETELEM	898.178
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	SERVICIOS FINANCIEROS CARREFOUR	658.844
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	419.693
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	568.313
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	616.582
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	271.962
IM BCG RMBS 2, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO CAIXA GERAL	710.332
IM CAJA LABORAL 1, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJA LABORAL POPULAR	120.413
IM CAJA LABORAL 2, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJA LABORAL POPULAR	270.226
IM CAJAMAR 3, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	178.430
IM CAJAMAR 4, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	186.460
IM CAJAMAR 5, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	188.426
IM CAJAMAR 6, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	471.003
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	270.917
IM PASTOR 4, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO PASTOR	138.660
WIZINK MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	WIZINK BANK	204.186
FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2014-1	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	117.007
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	7.124
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	350.576
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	662.349
FTA UCI 11	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	112.592
FTA UCI 14	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	269.289
FTA UCI 16	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	454.375
FTA, UCI 15	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	336.907
FTA, UCI 17	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	396.698
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	1.938.819
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNIÓN DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, E.F.C.	466.597
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-1	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER, EFC	148.685
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER, EFC	309.369
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER	625.891
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	478.511
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO V	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	277.005
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO VI	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	310.832
PYMES BANESTO 2, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO ESPAÑOL DE CRÉDITO	8.649
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	3.973.177
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	4.963.911

FONDO		TIPO		GESTORA	CEDEnte	TOTAL ACTIVO (1)
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER	385.901
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER	265.686
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER	1.099.336
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	FCA CAPITAL ESPAÑA E.F.C., S.A.U.	262.069
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	PSA FINANCIAL SERVICES SPAIN, E.F.C., S.A.	111.158
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	PSA FINANCIAL SERVICES SPAIN, E.F.C., S.A.	374.149
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK, BANCO SABADELL	134.829
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK, BANCO SABADELL	83.343
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK, BANCO SABADELL	32.790
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CAJA DE INGENIEROS	99.721
CEDULAS TDA 6, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	3.080.533
DRIVER ESPAÑA SIX, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	VOLKSWAGEN BANK	231.069
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	8.917.898
FTPYME TDA CAM 4, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	85.327
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	333.060
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	314.653
MADRID RMBS I, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	535.148
MADRID RMBS II, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	466.865
MADRID RMBS III, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	959.402
MADRID RMBS IV, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	765.975
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CETELEM	864.787
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	VOLKSWAGEN BANK	1.513.529
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	5.431.441
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	ING DIRECT	16.361.965
TDA 19 - MIXTO, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	48.927
TDA 22 - MIXTO, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	59.232
TDA 24, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	65.847
TDA 25, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	71.264
TDA 26 - MIXTO, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	102.039
TDA 27, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	183.865
TDA 28, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	144.037
TDA 29, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	163.913
TDA 30, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCA MARCH	110.550
TDA CAJAMAR 2, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CAJAMAR	111.746
TDA CAM 4, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	137.304
TDA CAM 5, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	314.765
TDA CAM 6, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	232.214
TDA CAM 7, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	347.009
TDA CAM 8, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	318.264
TDA CAM 9, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	331.486
TDA IBERCAJA 2, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	IBERCAJA	102.754
TDA IBERCAJA 3, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	IBERCAJA	149.992
TDA IBERCAJA 4, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	IBERCAJA	236.626
TDA IBERCAJA 5, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	IBERCAJA	246.132
TDA IBERCAJA 6, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	IBERCAJA	410.255
TDA IBERCAJA 7, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	IBERCAJA	789.911
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	4.198.272
TDA TARRAGONA 1, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	74.569
Subtotal FTA/BONOS constituidos en periodos anteriores						128.373.331

FONDO	TIPO			GESTORA	CEDENTE	TOTAL ACTIVO (1)
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.	733.517
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO CETELEM	631.010
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.150.374
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	12.592.010
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.658.704
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	RCI BANQUE SA	1.254.599
FONDO DE TITULIZACIÓN RMBS PRADO X	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	565.491
IM ANDBANK RMBS 1,FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	ANDBANK	174.802
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	743.863
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	687.996
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER, EFC	752.903
Subtotal FTA/BONOS constituidos en el periodo						20.945.269
Total FTA/BONOS						149.318.600
Subtotal FTA/PAGARÉS constituidos en periodos anteriores						0
Subtotal FTA/PAGARÉS constituidos en el periodo						0
Total FTA/PAGARÉS						0
Total FTA - PÚBLICOS						149.318.600
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	191.397
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	81.255
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	190.406
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	273.811
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	208.557
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	271.306
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	211.564
BANKINTER 11, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANKINTER	141.010
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	36.772
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	FTH	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	349.177
IM PASTOR 2, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO PASTOR	51.459
IM PASTOR 3, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO PASTOR	108.901
FTH UCI 12	FTH	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	153.428
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	FTH	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	417.624
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	IBERCAJA	78.083
Subtotal FTH constituidos en periodos anteriores						2.764.750
Subtotal FTH constituidos en el periodo						0
Total FTH - PÚBLICOS						2.764.750
Total FONDOS PUBLICOS						152.083.350
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO PASTOR	30.586
FTA2015, FTA	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CATALUNYA BANC	478.331
SLF, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	99.299
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	PATRIOT HOLDCO S.À.R.L.	54.893
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	952.925
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	CREALSA INVESTMENTS SPAIN, S.A.	10.475
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	ZEPa FINANCE, S.L.	799
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.	26.755
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	AQUISGRÁN FINANCE, S.A.	101.020
IM GEDESCLUB, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	SPINNAKER CAPITAL, S.L.	550
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	GEDESCO INNOVFIN S.L.	52.457
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCA MARCH	333.617
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCA MARCH	23.628
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO SABADELL	100.792
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	SACYR INDUSTRIAL OPERACIÓN Y MANTENIMIENTO, S.L	202.521
UFASA CONSUMER FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	UNIÓN FINANCIERA ASTURIANA, E.F.C., S.A.U.	124.306
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACIÓN	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	43.502
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	13.131
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	44.085
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	116.166
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	99.551
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	151.350
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	15.078
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACIÓN	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	260.268
ELECNR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACIÓN	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	ELECNR, S.A.	76.870
MONDEGO 2021, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	RIBEIRA HOLDING SARL	135.463
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	SÜD-WEST-KREDITBANK FINANZIERUNG GMBH	408.163
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	140.715
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
Subtotal FTA/PRIVADOS/BONOS constituidos en periodos anteriores						4.109.868

FONDO		TIPO		GESTORA	CEDENTE	TOTAL ACTIVO (1)
ASF 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	ATLAX SMART FIANANCING	476
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACIÓN	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CRISAE PRIVATE DEBT S.L.	19.351
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	CREALSA INVESTMENTS SPAIN, S.A.	3.177
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	ELLINGTON RESIDENTIAL HOLDINGS	557.057
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	312.439
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	MULTICEDENTE	24.082
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACIÓN	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	NPL CESION S.L.	6.092
PENSIUM ESG I, FONDO DE TITULIZACIÓN	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	PENSIUM DIRECT, S.L.	112
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	PERFECTA	12.539
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	NEPTUNE LUX HOLDCO, S.A.R.	415.756
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	FNPL ESP INVESTMENTS DESIGNATED	101.958
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BTL IV	173.659
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	TRADE & WORKING CAPITAL, S.A.U.	46.227
Subtotal FTA/PRIVADOS/BONOS constituidos en el periodo						1.672.925
Total FTA/PRIVADOS/BONOS						5.782.793
HT NEXUS, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	NEXUS ENERGÍA YELLOW ENERGY	5.738
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	MULTICEDENTE	13.514
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	TRADE & WORKING CAPITAL, S.A.U.	34.808
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	ZEPa FINANCE, S.L.	30.054
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	FORTIA	250.287
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	SUMMA ENERGY SERVICIOS FINANCIEROS	20.492
IM VALL COMPANYS 1, FONDO DE TITULIZACIÓN	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	MULTICEDENTE	11.118
Subtotal FTA/PRIVADOS/PAGARÉS constituidos en periodos anteriores						366.011
FACTOR ONE, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	PETROFACTOR, S.L.	15.796
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	ALTAMAR PRIVATE EQUITY S.G.J.J.C., S.A.U.	99.188
Subtotal FTA/PRIVADOS/PAGARÉS constituidos en el periodo						114.984
Total FTA/PRIVADOS/PAGARÉS						480.995
Total FTA - PRIVADOS						6.263.788
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	FTH	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	195.143
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.	340.430
Subtotal FTH/PRIVADOS constituidos en periodos anteriores						535.573
Subtotal FTH/PRIVADOS constituidos en el periodo						0
Total FTH - PRIVADOS						535.573
Total FONDOS PRIVADOS						6.799.361

(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	226.239	0	239.234	0	0	0
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	99.800	0	106.566	2.646	0	478
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	340.972	0	358.449	11	0	8.076
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	677.209	0	705.100	139	0	22.836
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	378.010	0	391.430	4.650	0	18.085
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	809.004	0	829.249	8.000	0	51.350
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	592.090	0	600.244	8.711	0	15.465
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	176.675	0	180.766	28.512	-905	0
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	55.204	200	56.620	19	-14.000	-575
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	3.202.941	0	3.202.103	69.064	-15	0
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	2.038.462	0	2.038.014	41.037	-12	0
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	1.039.183	0	1.077.775	88.335	-77.648	301
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	175.936	96	185.259	5.130	-1.474	1.102
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	72.039	0	76.206	4.789	-759	293
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	177.069	115	180.918	8.323	-1.309	1.130
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	252.901	770	263.431	8.656	-2.203	1.796
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	196.930	650	201.095	6.134	-5.276	1.370
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	242.504	275	252.975	18.292	-15.535	-1.643
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	179.201	768	183.180	28.349	-4.601	-1.863
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	1.217.009	1.463	1.234.072	124.565	0	-12.613
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	393.367	932	419.143	42.753	-1.956	-6.242
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	430.770	83	463.508	45.722	-3.644	-6.396
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	149.325	0	156.324	24.197	-32	966
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	189.071	0	197.356	10.885	0	1.703
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	0	0	247	1	-9.186	0
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	86.417	55	88.950	5.116	-287	488
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	43.243	0	45.234	4.746	-353	211
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	138.872	0	144.374	6.790	0	694
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	283.644	0	296.495	12.622	-2.254	-3.261
BANCAJA 10, FTA	586.916	12.532	617.998	2.174	-29.626	-4.363
BANCAJA 11, FTA	551.390	10.372	576.713	0	-30.132	-3.148
BANCAJA 13, FTA	1.102.284	18.262	1.111.354	162.193	-71.737	3.120
BANCAJA 8, FTA	169.335	3.045	197.074	0	-4.556	-553
BANCAJA 9, FTA	292.900	5.665	314.119	3.735	-19.334	-2.389
BANKINTER 10, FTA	199.445	76	211.795	0	-2.447	462
BANKINTER 11, FTH	125.939	105	135.464	0	-2.246	318
BANKINTER 13 FTA	290.103	462	314.087	435	-3.145	1.227
BANKINTER 9, FTA	108.152	398	113.071	7.834	-506	751
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	194.022	0	222.901	0	0	0
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	768.134	0	848.094	0	0	45.981
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACIÓN	1.038.334	0	1.093.918	0	0	45.319
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	849.937	0	890.160	0	0	0
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	1.253.329	0	1.288.416	125.050	0	0
BBVA CONSUMO 9, FONDO DE TITULIZACION	185.946	0	198.665	61.884	0	0
BBVA LEASING 1, FTA	3.021	37	3.934	0	-91.853	-2.224
BBVA LEASING 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	705.214	0	411.310	434.391	0	0
BBVA RMBS 1, FTA	614.785	2.723	609.560	37.740	-14.634	5.131
BBVA RMBS 14, FTA	315.942	0	317.824	32.098	-110	0
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	1.043.941	0	864.530	288.710	0	0
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	1.474.867	0	1.313.598	300.703	0	7.932
BBVA RMBS 2, FTA	1.152.029	8.624	1.142.238	32.118	-10.130	5.802
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	2.143.540	0	2.191.663	125.636	0	294.005
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	11.297.615	0	11.579.463	622.095	0	376.660
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	1.380.443	0	1.401.466	72.212	0	184.877
BBVA RMBS 3, FTA	1.033.130	8.245	1.063.839	0	-172.575	5.992
BBVA RMBS 5 FTA	1.723.643	2.834	1.719.200	195.437	-230.016	0
BBVA RMBS 9, FTA	602.613	58	462.265	200.407	0	0
BBVA-6 FTPYME FTA	5.741	2.231	8.158	0	-37.302	-681
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	119.905	172	122.074	7.435	0	988
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	38.844	354	36.744	42.874	0	122
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	24.713	511	19.471	6.954	0	61
CAIXABANK CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	132.610	0	140.056	52.116	-568	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	
CAIXABANK CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	257.391	0	265.604	11.602	0	0
CAIXABANK CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	101.909	0	133.416	6.694	0	0
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	965.592	0	1.156.714	68.512	0	0
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	401.824	0	424.606	23.467	0	0
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	806.870	0	896.193	39.306	0	0
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	948.212	0	1.046.329	53.501	0	0
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	1.293.808	0	1.339.534	73.243	0	0
CAIXABANK PYMES 8, FONDO DE TITULIZACION	356.557	0	384.202	71.968	0	0
CAIXABANK PYMES 9, FONDO DE TITULIZACION	260.428	0	272.663	10.754	-1.518	0
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	8.115.726	0	8.251.017	557.102	-21.242	0
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	1.681.038	0	1.740.489	105.860	-2.394	0
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	1.517.377	0	1.541.609	62.210	-1.626	0
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	79.542	0	82.554	17.153	-643	0
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	1.193.775	0	1.227.860	14.460	0	0
CEDULAS TDA 6, FTA	3.070.705	0	3.070.705	0	0	0
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	603.602	0	566.015	88.670	0	0
DRIVER ESPAÑA SIX, FONDO DE TITULIZACION	198.313	0	182.199	12.275	-2.764	3.674
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	3.743	257	1.389	7.372	-14.191	71
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	101.076	0	133.776	3.106	-16.263	-527
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	76.911	0	97.295	3.381	-10.638	757
FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2014-1	76.157	0	116.969	0	-227	0
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	5.637	170	6.640	0	-50.369	517
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	312.293	5.276	342.157	0	-13.266	9.383
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	608.586	15.626	646.447	0	-150.272	17.741
FTA UCI 11	99.338	0	95.472	12.767	0	0
FTA UCI 14	255.812	49	241.627	11.613	0	0
FTA UCI 16	435.838	68	427.939	0	0	0
FTA, UCI 15	323.315	134	322.923	0	0	0
FTA, UCI 17	382.183	97	378.518	0	0	-1.633
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	8.427.567	0	8.348.615	53.434	0	0
FTH UCI 12	142.389	0	138.180	10.362	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	1.507.513	32	1.938.678	0	-17.937	0
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	402.310	0	405.949	6.231	-2.352	53.192
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	402.994	0	406.049	4.626	-4.444	3.463
FONDO DE TITULIZACIÓN RMBS PRADO X	522.182	0	525.128	7.580	-3.648	30.310
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-1	112.556	0	147.851	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2	276.308	0	303.318	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	563.645	0	576.208	0	-2.142	45.451
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	437.229	0	440.375	3.322	-6.079	29.933
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO V	268.147	0	270.422	6.339	-423	0
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO VI	288.143	0	291.024	5.977	-639	13.866
FTPYME TDA CAM 4, FTA	55.412	4.859	85.368	0	-14.594	11
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	24.796	0	31.887	0	-3.817	441
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	3.554	2.399	6.209	78	-26.165	28
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	116.211	7.880	126.308	0	-42.906	-2.551
HIPOCAT 10, FTA	165.024	2.838	175.767	0	-65.827	3.597
HIPOCAT 11, FTA	179.998	5.224	193.031	0	-124.130	2.432
HIPOCAT 8, FTA	142.501	2.446	142.676	11.261	0	1.926
HIPOCAT 9, FTA	111.937	1.697	127.402	0	-12.227	2.091
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	570.730	0	430.823	202.043	-1.627	0
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	597.018	0	498.268	160.025	-1.595	0
IM ANDBANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	159.915	0	174.582	209	-216	0
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	392.011	0	396.165	0	0	0
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	546.645	0	552.164	2	0	0
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	569.075	0	585.186	8.442	0	0
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	698.836	0	714.045	19.817	0	0
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	237.393	0	258.026	452	0	0
IM BCG RMBS 2, FTA	649.883	0	538.390	131.906	-414	0
IM CAJA LABORAL 1, FTA	105.790	0	116.981	0	0	1.063
IM CAJA LABORAL 2, FTA	236.743	0	238.388	18.917	0	-374
IM CAJAMAR 3, FTA	160.538	0	160.055	0	0	-702
IM CAJAMAR 4, FTA	172.535	0	176.887	0	0	-755

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	
IM CAJAMAR 5, FTA	176.238	0	182.405	0	-290	0
IM CAJAMAR 6, FTA	435.532	0	458.229	0	-1.018	0
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	210.246	0	207.580	56.317	-214	1.270
IM PASTOR 2, FTH	43.267	589	41.898	5.014	-224	1.069
IM PASTOR 3, FTH	90.621	11.506	104.087	4.724	-52.768	-1.548
IM PASTOR 4, FTA	121.288	15.144	131.903	6.409	-12.206	-2.382
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	286.557	7.334	140.037	192.267	-10.535	-436
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	272.797	4.498	142.815	169.667	0	1.472
MADRID RMBS I, FTA	464.379	18.096	456.984	50.909	-45.378	-4.798
MADRID RMBS II, FTA	406.959	15.300	395.083	43.261	-54.591	-3.291
MADRID RMBS III, FTA	859.235	39.173	874.943	50.814	-129.414	-4.144
MADRID RMBS IV, FTA	637.854	28.432	629.636	134.329	-194.029	-2.981
MBS BANCAJA 3, FTA	86.626	1.359	90.376	0	-686	-654
MBS BANCAJA 4, FTA	264.178	6.115	271.434	1.637	-2.011	-888
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	828.996	0	850.015	2.380	0	0
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	1.438.250	0	1.386.020	11.250	0	0
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	5.274.691	0	5.274.691	102.853	0	0
PYMES BANESTO 2, FTA	3.161	5.333	7.501	1.096	-39.720	18
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	3.672.121	1.057	3.949.666	0	0	0
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	4.654.983	219	4.961.341	758	0	0
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA	91.788	323	100.337	0	0	602
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	251.026	713	257.971	0	-29	577
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	140.939	407	149.468	0	0	483
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	360.024	777	368.309	22.684	-244	1.659
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	470.175	475	473.521	42.632	0	1.056
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	253.678	158	255.465	27.716	-59	-412
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	75.313	0	77.251	11.546	-171	0
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	321.316	0	329.699	18.630	0	0
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	213.195	0	218.862	27.242	-271	0
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	52.580	0	55.648	7.862	-87	0
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	34.084	0	24.391	25.990	-937	0
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	166.945	0	169.967	11.714	-39	0
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	184.233	0	207.711	0	0	8.091
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	637.434	0	659.374	0	0	20.539
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	352.774	0	362.950	0	0	20.409
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	245.675	0	249.260	0	0	13.185
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	689.109	0	707.849	4.692	-179	9.784
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	1.007.783	0	1.025.851	0	0	56.799
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	15.414.626	0	15.758.444	120.407	0	438.941
TDA 19 - MIXTO, FTA	35.585	0	35.784	11.733	0	34
TDA 22 - MIXTO, FTA	49.940	5.052	49.068	5.894	0	125
TDA 24, FTA	55.470	6.942	64.301	2	-14.049	5
TDA 25, FTA	54.297	16.174	70.374	532	-46.379	0
TDA 26 - MIXTO, FTA	89.482	0	95.980	8	0	179
TDA 27, FTA	166.415	14.404	174.461	9.320	-34.135	0
TDA 28, FTA	122.308	17.732	139.433	4.519	-78.161	0
TDA 29, FTA	152.784	0	155.619	0	0	1.712
TDA 30, FTA	101.790	0	105.051	0	0	1.760
TDA CAJAMAR 2, FTA	95.671	0	95.644	3.392	0	10
TDA CAM 4, FTA	111.609	2.340	102.814	20.007	0	207
TDA CAM 5, FTA	277.111	10.225	266.904	11.061	0	1.874
TDA CAM 6, FTA	197.714	11.689	184.121	18.184	0	1.054
TDA CAM 7, FTA	310.812	13.335	292.314	10.967	0	1.789
TDA CAM 8, FTA	286.246	12.108	275.380	6.655	0	1.362
TDA CAM 9, FTA	294.953	16.571	301.087	7.227	0	1.710
TDA IBERCAJA 2, FTA	91.245	0	98.577	0	0	185
TDA IBERCAJA 3, FTA	140.972	0	148.644	0	0	-51
TDA IBERCAJA 4, FTA	219.467	0	233.021	0	0	14
TDA IBERCAJA 5, FTA	230.087	0	243.284	0	0	-463
TDA IBERCAJA 6, FTA	373.337	0	383.944	22.240	0	-2.821
TDA IBERCAJA 7, FTA	712.933	0	782.325	0	0	-1.820
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	55.602	0	78.161	58	-3.853	-1.705
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	3.842.591	0	3.902.244	137.100	0	61.918
TDA TARRAGONA 1, FTA	59.716	0	66.338	0	0	136

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	
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	125.555	2.048	127.648	0	0	213
WIZINK MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	194.400	0	131.009	77.462	-50.388	0
Subtotal BONOS 31/12/2022	138.812.703	416.793	141.241.307	6.829.625	-2.251.026	1.894.393
Subtotal BONOS 31/12/2021	140.815.934	513.532	142.052.625	7.375.642	-2.172.425	-440.995
%Variación	-1,42	-18,84	-0,57	-7,40	3,62	-529,57
PAGARES						
Subtotal PAGARÉS 31/12/2022	0	0	0	0	0	0
Subtotal PAGARÉS 31/12/2021	0	0	0	0	0	0
%Variación	-	-	-	-	-	-

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	
PRIVADOS						
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	8.622	0	10.444	22	-30	0
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	75.183	0	83.016	658	-748	0
ASF 1, FONDO DE TITULIZACION	217	0	438	29	-262	0
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	30.586	0	30.586	0	0	0
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACIÓN	260.265	0	259.785	0	-9.661	0
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	692.958	0	833.168	116.815	0	0
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACIÓN	37.924	0	35.009	0	0	2.651
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACIÓN	19.000	0	18.911	0	-299	0
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	1.077	0	3.110	55	-145	0
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	30.033	0	30.016	0	0	0
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	655	0	678	36	-407	0
ELECNR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACIÓN	75.931	0	33.702	0	0	0
FACTOR ONE, FONDO DE TITULIZACION	140	0	15.034	570	-466	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	0	0	224.213	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	0	0	11.117	0	-118	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	0	0	37.105	0	-1.161	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	0	0	102.945	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	0	0	89.800	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	0	0	126.268	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	13.095	0	13.095	0	-4	0
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	365.003	0	368.513	0	-165.487	0
FTA2015, FTA	448.650	0	470.482	1.334	-2.406.571	0
HT NEXUS, FONDO DE TITULIZACION	3.550	0	5.184	0	0	0
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	11.720	0	12.861	0	0	0
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	26.375	0	33.371	0	0	0
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	23.781	0	22.935	0	0	0
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	99.126	0	99.174	2	-310	0
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	137.547	0	249.219	569	0	0
IM GEDESCLUB, FONDO DE TITULIZACION	0	0	274	0	-229	0
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	49.709	0	51.929	0	-529	0
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	332.903	0	333.138	0	-256	0
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	23.530	0	23.555	0	-150	0
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	18.097	0	20.329	99	0	0
IM VALL COMPANYS 1, FONDO DE TITULIZACIÓN	1.600	0	10.985	79	-113	0
MONDEGO 2021, FONDO DE TITULIZACION	133.940	0	135.275	0	-156	0
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	100.557	0	100.778	0	-33	0
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACIÓN	5.589	0	6.035	0	-186	0
PENSUM ESG I, FONDO DE TITULIZACIÓN	103	0	99	0	-101	0
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	12.153	0	11.734	767	-685	22
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	197.677	0	94.234	0	0	0
SLF, FONDO DE TITULIZACION	95.108	0	96.416	0	-17.340	0
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	54.383	0	54.809	0	-29.174	0
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	415.753	0	415.651	95	-102	0
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	388.237	0	400.016	6.953	0	0
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	140.713	0	140.077	0	-1.591	0
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	195.093	0	194.811	0	-9.997	0
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	12.572	0	12.529	0	-335	0
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	99.296	0	101.734	0	-4.266	0
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	168.027	0	172.872	0	-11.345	0
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	24.117	0	45.343	0	-46	0
UFASA CONSUMER FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	121.335	0	122.547	636	0	0
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	312.454	0	242.867	0	0	0
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	19.987	0	26.601	0	-5.679	0
Subtotal PRIVADOS 31/12/2022	5.284.371	0	6.034.817	128.719	-2.667.982	2.673
Subtotal PRIVADOS 31/12/2021	4.884.172	0	6.546.774	131.470	-2.232.959	-1.659
%Variación	8,19	-	-7,82	-2,09	19,48	-261,12
Total 31/12/2022	144.097.074	416.793	147.276.124	6.958.344	-4.919.008	1.897.066
Total 31/12/2021	145.700.106	513.532	148.599.399	7.507.112	-4.405.384	-442.654
%Variación	-1,10	-18,84	-0,89	-7,31	11,66	-528,57

Importe pendiente derechos de crédito
CUADRO A.1.1

Miles de euros

FONDO	HIPOTECIARIOS	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															
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	8.218	341
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	74.976	89
ASF 1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	214	3
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	0	0	0	224.364	0	0	0	0	0	-	726	1.149
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	98.902	0	0	0	0	0	-	326	572
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	338.525	0	0	0	0	0	-	344	2.103
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	676.434	0	0	0	0	0	-	152	622
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	374.583	0	0	0	0	0	-	1.319	2.108
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	803.688	0	0	0	0	0	-	1.117	4.199
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	588.950	0	0	0	0	0	-	45	3.095
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	29.629	0	957
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	175.831	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	778	66
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	54.616	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	560	29
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	0	3.145.000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	0	57.941
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	0	2.000.000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	0	38.462
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	1.026.841	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	11.534	809
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	175.621	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	239	76
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	71.987	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	17	36
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	176.675	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	311	84
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	252.004	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	743	154
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	196.398	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	421	111
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	241.960	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	450	94
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	178.470	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	614	116
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	1.212.256	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	4.174	578
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	390.935	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	2.230	202
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	428.298	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	2.192	280
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	148.123	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	1.105	97
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	186.719	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	2.230	122
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	85.462	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	905	51
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	42.856	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	346	41
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	138.296	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	425	151
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	280.605	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	2.702	337
BANCAJA 10, FTA	541.365	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	44.975	576
BANCAJA 11, FTA	503.321	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	47.577	492
BANCAJA 13, FTA	1.072.670	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	28.567	1.047
BANCAJA 8, FTA	160.624	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	8.541	170
BANCAJA 9, FTA	267.151	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	25.435	314
BANKINTER 10, FTA	196.697	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	2.608	140
BANKINTER 11, FTH	123.988	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	1.888	63
BANKINTER 13 FTA	284.264	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	5.662	177
BANKINTER 9, FTA	106.122	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	1.961	69
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE	0	0	0	0	0	0	191.844	0	0	0	0	0	-	1.495	683
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	761.185	0	0	0	0	0	-	4.341	2.608
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	1.033.139	0	0	0	0	0	-	2.039	3.156

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
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	840.959	0	0	0	0	-	-	8.294	684
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	1.241.841	0	0	0	0	-	-	10.560	928
BBVA CONSUMO 9, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	184.028	0	0	0	0	-	-	1.742	176
BBVA LEASING 1, FTA	0	0	0	0	0	0	2.990	0	0	0	-	-	29	2
BBVA LEASING 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	0	0	0	698.091	0	0	0	-	-	6.376	747
BBVA RMBS 1, FTA	600.707	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	13.999	79
BBVA RMBS 14, FTA	314.781	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	980	181
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	1.040.390	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.248	303
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	1.472.549	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.964	354
BBVA RMBS 2, FTA	1.123.567	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	28.280	182
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	2.141.839	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.420	281
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	11.289.801	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	5.477	2.337
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	1.380.299	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	144
BBVA RMBS 3, FTA	999.642	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	33.194	294
BBVA RMBS 5 FTA	1.700.011	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	23.221	411
BBVA RMBS 9, FTA	597.217	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	5.230	166
BBVA-6 FTPYME FTA	0	0	0	1.964	0	0	0	0	0	0	-	-	3.776	1
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	260.265	0
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	115.860	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.955	90
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	0	0	0	36.563	0	0	0	0	0	0	-	-	2.254	28
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	0	0	0	19.435	0	0	0	0	0	0	-	-	5.261	16
CAIXABANK CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	0	0	127.586	0	0	0	0	-	-	4.746	278
CAIXABANK CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	248.879	0	0	0	0	-	-	7.913	600
CAIXABANK CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	99.672	0	0	0	0	-	-	1.656	581
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	948.523	0	0	0	0	-	-	11.179	5.890
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	691.188	0	1.771
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	400.403	0	0	0	-	-	1.417	4
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	785.133	0	0	0	0	0	0	-	-	19.499	2.238
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	933.506	0	0	0	0	0	0	-	-	12.049	2.657
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	1.278.332	0	0	0	0	0	0	-	-	12.426	3.050
CAIXABANK PYMES 8, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	351.064	0	0	0	0	0	0	-	-	4.532	961
CAIXABANK PYMES 9, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	253.624	0	0	0	0	0	0	-	-	5.920	885
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	8.014.926	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	91.265	9.535
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	1.655.554	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	22.964	2.520
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	1.479.265	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	35.724	2.387
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	79.390	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	125	27
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE	0	0	0	0	0	1.189.199	0	0	0	0	-	-	0	4.576
CEDULAS TDA 6, FTA	0	3.000.000	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	70.705
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	35.000	0	2.924
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	597.074	0	0	0	0	-	-	5.531	998
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	19.000	0	0
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.051	0	26
DRIVER ESPAÑA SIX, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	197.464	0	0	0	0	-	-	716	134
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	30.000	0	33
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	645	0	10
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	0	0	0	1.291	0	0	0	0	0	0	-	-	2.450	2

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
ELECNR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	75.931	0	0
FACTOR ONE, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	139	0	1
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	0	0	0	97.110	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.816	150
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	0	0	0	72.963	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.835	112
FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2014-1	0	0	0	0	0	0	74.327	0	0	0	0	-	-	1.308	522
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	0	0	0	0	0	0	5.636	0	0	0	0	-	-	0	1
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	306.453	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	5.720	120
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	594.178	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	14.181	227
FTA UCI 11	87.996	0	0	0	0	0	3.381	0	0	0	0	-	-	7.458	503
FTA UCI 14	209.357	0	0	0	0	0	0	0	0	0	15.758	-	-	29.279	1.418
FTA UCI 16	364.854	0	0	0	0	0	0	0	0	0	17.352	-	-	51.474	2.158
FTA, UCI 15	271.088	0	0	0	0	0	16.599	0	0	0	0	-	-	34.247	1.381
FTA, UCI 17	335.162	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	44.924	2.097
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	8.427.567	-	-	0	0
FTH UCI 12	129.712	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	11.837	840
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	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	1.501.766	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.821	2.926
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	401.794	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	506	10
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	402.967	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	27
FONDO DE TITULIZACIÓN RMBS PRADO X	522.180	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	2
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER	0	0	0	0	0	0	110.255	0	0	0	0	-	-	1.778	523
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER	0	0	0	0	0	0	270.968	0	0	0	0	-	-	2.135	3.205
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER	0	0	0	0	0	0	561.690	0	0	0	0	-	-	0	1.955
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	13.091	0	4
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	176.562	188.230	211
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	437.203	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	26
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO V	267.209	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	930	8
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO VI	287.197	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	935	11
FTA2015, FTA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	52.517	395.876	257
FTPYME TDA CAM 4, FTA	0	0	0	45.205	0	0	0	0	0	0	0	-	-	10.184	23
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	24.444	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	339	13
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	0	0	0	3.499	0	0	0	0	0	0	0	-	-	53	2
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	111.940	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.264	7
HIPOCAT 10, FTA	159.289	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	5.713	22
HIPOCAT 11, FTA	175.419	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.549	30
HIPOCAT 8, FTA	137.988	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.492	21
HIPOCAT 9, FTA	109.164	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.762	11
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	569.295	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	984	451
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	594.673	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.718	627
HT NEXUS, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3.550	0	0
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	11.720	0	0

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
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	26.375	0	0
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	22.353	1.001	427
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	97.969	0	1.156
IM ANDBANK RMBS 1,FONDO DE TITULIZACION	159.831	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	83
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	390.741	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	760	509
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	545.315	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	605	726
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	563.364	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.235	2.476
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	693.030	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.871	2.935
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	234.902	0	0	0	0	0	0	0	-	-	656	1.835
IM BCG RMBS 2, FTA	643.947	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	5.395	541
IM CAJA LABORAL 1, FTA	104.353	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.354	84
IM CAJA LABORAL 2, FTA	232.009	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.523	211
IM CAJAMAR 3, FTA	158.049	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.388	101
IM CAJAMAR 4, FTA	169.070	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.303	163
IM CAJAMAR 5, FTA	172.738	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.357	144
IM CAJAMAR 6, FTA	427.734	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	7.506	292
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	207.355	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.773	118
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	137.273	0	273
IM GEDESCLUB, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	48.312	1.396	0
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	331.252	0	1.651
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	23.506	0	24
IM PASTOR 2, FTH	40.618	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.649	0
IM PASTOR 3, FTH	70.355	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	20.265	2
IM PASTOR 4, FTA	97.021	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	24.265	2
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	17.980	0	116
IM VALL COMPANYS 1, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.600	0	0
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	281.650	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.674	233
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	270.216	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.366	215
MADRID RMBS I, FTA	448.745	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	15.225	409
MADRID RMBS II, FTA	389.863	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	16.733	363
MADRID RMBS III FTA	818.696	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	39.866	673
MADRID RMBS IV, FTA	610.947	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	26.416	491
MBS BANCAJA 3, FTA	78.875	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	7.671	80
MBS BANCAJA 4, FTA	232.112	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	31.828	238
MONDEGO 2021, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	101.418	32.076	447
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	100.000	0	557
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	818.195	0	0	0	0	-	-	6.052	4.750
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	5.589	0
PENSUM ESG I, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	101	0	2
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	11.901	178	74
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	1.432.936	0	0	0	0	-	-	2.430	2.884
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	0	5.115.000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	159.691
PYMES BANESTO 2, FTA	0	0	0	2.028	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.132	1
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	3.638.378	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	30.120	3.623
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	4.618.138	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	33.393	3.452
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA	88.186	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.536	66

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 IX, FTA	240.823	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	10.009	194
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	135.799	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	5.024	116
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	355.839	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.920	265
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	464.436	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	5.418	321
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	251.051	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.484	143
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	74.389	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	866	58
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	318.965	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.866	485
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	211.639	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.399	157
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	52.095	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	452	33
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	33.964	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	83	37
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	165.885	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	896	164
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	181.460	0	0	0	0	-	-	2.586	187
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	635.512	0	0	0	0	-	-	1.407	515
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	197.677	0	0
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO	0	0	0	0	0	0	351.145	0	0	0	0	-	-	0	1.629
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO	0	0	0	0	0	0	244.691	0	0	0	0	-	-	0	984
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01,	0	0	0	0	0	0	683.824	0	0	0	0	-	-	0	5.285
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	1.002.389	0	0	0	0	-	-	0	5.394
SLF, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	20.602	74.506	0
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	54.698	-315	0
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	415.753	0	0
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	15.361.689	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	25.397	27.540
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	388.106	0	132
TDA 19 - MIXTO, FTA	35.139	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	413	33
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.685	139.028	0
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	195.093	0
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	12.572	0
TDA 22 - MIXTO, FTA	44.053	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	5.845	42
TDA 24, FTA	42.949	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	12.469	52
TDA 25, FTA	36.868	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	17.366	63
TDA 26 - MIXTO, FTA	84.596	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.797	89
TDA 27, FTA	144.039	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	22.230	147
TDA 28, FTA	97.773	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	24.393	141
TDA 29, FTA	147.916	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.724	144
TDA 30, FTA	100.070	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.586	134
TDA CAJAMAR 2, FTA	94.202	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.407	61
TDA CAM 4, FTA	100.868	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	10.681	60
TDA CAM 5, FTA	256.001	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	20.960	150
TDA CAM 6, FTA	179.159	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	18.463	92
TDA CAM 7, FTA	288.133	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	22.508	172
TDA CAM 8, FTA	262.562	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	23.509	176
TDA CAM 9, FTA	270.585	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	24.217	151
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	99.296	0
TDA IBERCAJA 2, FTA	90.571	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	663	11
TDA IBERCAJA 3, FTA	140.259	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	697	16
TDA IBERCAJA 4, FTA	217.895	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.543	29
TDA IBERCAJA 5, FTA	228.418	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.637	32

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	DEUDA	AAPP	CONSUMO Y AUTOMOCIÓN	CUENTAS A	DERECHOS	BONOS DE TITULIZACIÓN	OTROS	PAGARÉS	PRIVADOS	DUDOSOS - DETERIORO	INTERESES
				EMPRESAS, CORPORATIVOS Y PYMES	SUBORDINADA Y BONOS DE TESORERÍA			COBRAR Y CUOTAS DE LEASING	DE CRÉDITO FUTUROS						+ AJUSTES
TDA IBERCAJA 6, FTA	370.747	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.533	58
TDA IBERCAJA 7, FTA	709.268	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.574	90
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	55.387	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	188	27
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	3.793.646	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	47.497	1.448
TDA TARRAGONA 1, FTA	58.323	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.310	84
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	168.027	0
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	24.117	0	0
UFASA CONSUMER FINANCE, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	117.991	2.473	871
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	120.786	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.657	112
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	26.970	285.406	79
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	19.390	455	142
WIZINK MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	191.062	0	0	0	0	-	-	3.059	279
Total 31/12/2022	89.757.243	13.260.000	0	6.874.779	0	0	17.350.908	1.101.484	0	0	8.460.677	0	3.410.460	3.376.116	505.410
Total 31/12/2021	84.509.180	14.660.000	0	9.103.080	0	0	18.214.575	1.818.522	0	0	10.300.810	0	3.155.943	3.465.728	472.269
%Variación	6,21	-9,55	-	-24,48	-	-	-4,74	-39,43	-	-	-17,86	-	8,06	-2,59	7,02

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

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

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
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	5,59	56,78	1,64	7,79	0,00	17,21	15,85	0,74	1,61	MADRID	51,77
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	4,66	60,90	0,87	5,48	0,11	17,99	15,79	0,69	1,84	MADRID	53,07
MADRID RMBS I, FTA	5,22	58,17	4,00	17,34	0,14	13,07	17,54	0,95	0,78	MADRID	69,57
MADRID RMBS II, FTA	5,34	57,78	4,28	18,53	0,00	13,06	17,53	0,93	0,94	MADRID	69,20
MADRID RMBS III, FTA	4,82	62,97	4,82	17,77	0,00	16,34	16,94	0,82	0,50	MADRID	65,41
MADRID RMBS IV, FTA	4,99	59,98	4,27	19,08	0,00	16,82	16,50	0,74	0,84	MADRID	66,76
MBS BANCAJA 3, FTA	6,27	28,56	8,85	4,33	0,30	9,43	17,78	0,81	2,57	C.VALENCIANA	43,54
MBS BANCAJA 4, FTA	5,35	31,60	12,07	5,52	0,28	10,96	16,92	0,69	1,54	C.VALENCIANA	43,61
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	4,27	88,66	1,65	0,01	0,00	26,14	0,37	1,48	0,53	MADRID	27,51
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	3,77	92,26	1,18	0,00	0,00	21,52	1,70	1,33	0,27	ANDALUCÍA	21,84
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA	5,85	27,35	3,84	0,34	0,00	8,70	18,47	0,93	1,67	C.VALENCIANA	49,48
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	5,48	34,49	4,04	1,44	0,00	11,82	17,05	0,99	0,86	C.VALENCIANA	36,88
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	5,46	28,43	3,57	0,48	0,00	9,76	18,03	0,95	1,31	ANDALUCÍA	31,17
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	5,48	35,08	1,09	0,48	0,00	13,73	16,13	0,84	0,73	C.VALENCIANA	32,30
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	5,20	35,88	1,15	0,38	0,00	14,33	15,76	0,82	0,61	C.VALENCIANA	35,49
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	4,56	34,75	0,98	0,04	0,00	14,05	15,54	0,83	0,94	C.LA MANCHA	36,42
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	4,89	38,80	1,15	0,00	0,00	15,75	13,40	0,71	3,30	ARAGÓN	88,56
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	6,45	55,57	0,58	0,00	0,00	20,10	7,08	1,38	1,15	CANARIAS	41,55
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	5,62	36,97	0,66	0,00	0,00	15,95	13,52	0,75	1,09	ANDALUCÍA	34,58
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	9,03	39,89	0,86	0,00	0,00	15,99	13,42	0,81	4,02	C.LEÓN	55,56
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	6,51	47,05	0,25	0,00	0,00	19,84	10,94	1,14	5,42	ARAGÓN	53,51
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	6,88	48,17	0,53	0,00	0,00	17,59	9,53	1,19	1,56	ARAGÓN	88,33
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	11,28	57,19	0,16	0,00	0,00	25,62	5,98	1,31	0,07	MADRID	29,30
TDA 19 - MIXTO, FTA	4,74	25,22	1,15	0,00	0,00	7,77	20,24	2,02	2,44	CATALUÑA	45,29
TDA 22 - MIXTO, FTA	5,32	38,01	11,39	7,53	0,02	10,70	19,64	1,18	2,62	CATALUÑA	43,48
TDA 24, FTA	4,19	35,72	22,34	20,37	0,30	9,34	18,95	1,45	2,80	C.LA MANCHA	46,17
TDA 25, FTA	2,42	49,64	32,09	33,69	0,09	12,79	17,62	1,34	2,54	ANDALUCÍA	44,66
TDA 26 - MIXTO, FTA	6,62	30,17	5,24	0,06	0,00	10,26	17,98	0,90	2,96	BALEARES	30,08
TDA 27, FTA	4,93	36,82	13,00	16,85	0,35	13,56	17,80	0,93	1,35	CATALUÑA	36,17
TDA 28, FTA	3,49	48,72	22,67	28,89	0,15	17,94	17,00	1,30	2,52	CATALUÑA	48,53
TDA 29, FTA	6,12	38,44	3,05	0,01	0,00	14,67	16,87	0,73	2,07	BALEARES	36,28
TDA 30, FTA	4,66	39,87	1,56	0,00	0,00	16,39	16,35	0,62	2,78	BALEARES	49,90
TDA CAJAMAR 2, FTA	4,91	27,04	1,46	0,00	0,00	9,38	18,59	2,88	1,41	ANDALUCÍA	41,02
TDA CAM 4, FTA	5,12	22,72	9,49	0,76	0,00	5,97	20,03	0,90	1,31	C.VALENCIANA	50,02
TDA CAM 5, FTA	5,27	33,35	7,57	2,12	0,00	10,43	18,94	0,82	0,61	C.VALENCIANA	36,44
TDA CAM 6, FTA	5,11	38,61	9,46	4,50	0,01	12,27	17,91	0,79	0,89	C.VALENCIANA	41,76
TDA CAM 7, FTA	6,12	39,90	7,33	3,82	0,00	13,52	17,61	0,77	0,94	C.VALENCIANA	35,67
TDA CAM 8, FTA	5,18	35,38	8,55	2,91	0,00	12,23	18,11	0,76	1,09	C.VALENCIANA	42,51
TDA CAM 9, FTA	5,38	39,79	8,20	3,82	0,04	15,01	16,64	0,74	1,20	C.VALENCIANA	42,03
TDA IBERCAJA 2, FTA	6,28	28,04	0,72	0,04	30,11	8,44	19,45	0,70	1,54	MADRID	29,47

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 IBERCAJA 3, FTA	6,47	31,20	0,50	0,08	30,30	10,74	18,41	0,68	1,02	MADRID	36,33
TDA IBERCAJA 4, FTA	6,20	34,16	0,70	0,12	71,07	11,38	18,17	0,64	1,13	MADRID	30,75
TDA IBERCAJA 5, FTA	6,29	38,37	0,71	0,27	29,23	12,89	17,69	0,63	0,97	MADRID	28,61
TDA IBERCAJA 6, FTA	6,22	40,39	0,67	0,19	51,34	15,37	16,92	0,65	0,85	MADRID	30,09
TDA IBERCAJA 7, FTA	6,02	42,47	0,50	0,02	76,59	17,77	15,71	0,53	0,57	MADRID	34,11
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	6,52	21,89	0,34	0,00	0,00	5,66	16,15	1,36	1,22	MADRID	42,53
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	6,30	60,31	1,27	0,00	0,00	21,89	13,25	1,03	0,32	CATALUÑA	33,50
TDA TARRAGONA 1, FTA	6,07	39,72	2,13	3,23	0,00	14,43	17,84	0,99	2,88	CATALUÑA	95,10
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	6,73	28,51	3,77	1,32	0,40	9,51	17,69	0,80	1,96	C.VALENCIANA	69,69
Total 31/12/2022	6,58	56,93	1,69	1,66	7,66	20,01	11,14	1,19	0,54		30,66
Total 31/12/2021	3,54	57,31	2,03	1,83	3,57	20,26	10,64	0,75	0,57		32,30
%Variación	85,88	-0,66	-16,75	-9,29	114,57	-1,23	4,70	58,67	-5,26		-5,08

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

FONDO	TAA (1)	VIDA RESIDUAL (2)	ANTIGÜEDAD (3)	INTERES (4)	TASA DE CONCENTRACIÓN	
					GEOGRÁFICA	
					ÁREA	PORCENTAJE
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	0,00	1,78	16,24	4,21	C.LEÓN	24,01
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	0,00	2,50	17,51	3,75	GALICIA	20,51
CEDULAS TDA 6, FTA	0,00	2,39	17,63	3,88	MADRID	21,67
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	0,00	7,25	16,84	4,25	ANDALUCÍA	27,17
Total 31/12/2022	0,00	4,15	16,98	4,08		24,18
Total 31/12/2021	0,00	4,71	15,89	4,09		23,32
%Variación	-	-11,89	6,86	-0,24		3,69

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)	POR DEUDOR (9)	TASA DE CONCENTRACIÓN	
										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
- (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	TASA DE CONCENTRACIÓN										SECTOR	PORCENTAJE
	TAA (1)	% DEUDA / VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	POR DEUDOR (9)	CNAE		
BBVA-6 FTPYME FTA	3,88	26,35	92,21	37,11	0,00	4,08	17,21	1,99	51,66	23.FABRICACIÓN DE OTROS PRODUCTOS MINERALES NO METÁLICOS	17,07	
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	4,55	30,81	5,89	1,40	0,00	10,62	16,89	1,64	11,32	70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL	23,34	
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	5,00	30,43	21,84	1,68	0,00	8,14	17,52	1,99	19,67	70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL	38,53	
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	6,65	32,25	3,22	4,67	19,68	6,64	7,29	2,44	9,44	68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS	16,83	
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	5,94	40,01	1,99	2,82	16,05	6,02	4,60	2,30	11,29	55.SERVICIOS DE ALOJAMIENTO	13,91	
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	6,15	38,80	1,64	0,97	27,68	4,83	3,21	1,97	7,79	01.AGRICULTURA, GANADERÍA, CAZA Y SERVICIOS RELACIONADOS CON LAS MISMAS	13,38	
CAIXABANK PYMES 8, FONDO DE TITULIZACION	6,33	32,64	1,51	6,17	16,39	8,65	10,63	2,49	10,15	68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS	19,87	
CAIXABANK PYMES 9, FONDO DE TITULIZACION	12,85	36,87	3,29	11,03	12,53	6,46	7,34	2,58	12,30	68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS	14,79	
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	0,36	30,31	82,86	24,70	0,39	5,28	17,92	3,36	47,63	68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS	26,97	
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	7,90	30,81	4,26	21,81	10,01	11,80	17,19	1,83	6,31	68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS	18,45	
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	8,05	32,69	5,80	19,63	9,44	12,58	16,54	1,83	4,78	47.COMERCIO AL POR MENOR, EXCEPTO DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS	21,84	
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	0,92	27,28	2,55	0,00	0,00	4,13	5,15	2,80	6,24	C. INDUSTRIA MANUFACTURERA	0,90	
FTPYME TDA CAM 4, FTA	3,83	30,96	23,86	4,64	0,03	7,54	15,97	0,72	11,56	74.OTRAS ACTIVIDADES PROFESIONALES, CIENTÍFICAS Y TÉCNICAS	18,08	
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	0,41	17,37	1,51	83,00	5,00	5,95	17,36	2,43	59,14	29.FABRICACIÓN DE VEHÍCULOS DE MOTOR, REMOLQUES Y SEMIRREMOLQUES	43,88	
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	4,89	52,17	0,96	0,00	0,00	6,59	4,62	3,18	4,06	11. FABRICACIÓN DE BEBIDAS	18,97	
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	0,00	45,64	0,64	0,00	0,00	7,53	3,20	2,86	3,73	01.AGRICULTURA, GANADERÍA, CAZA Y SERVICIOS RELACIONADOS CON LAS MISMAS	23,71	
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	5,70	37,86	1,20	0,00	0,00	5,92	6,50	3,15	4,88	01.AGRICULTURA, GANADERÍA, CAZA Y SERVICIOS RELACIONADOS CON LAS MISMAS	43,11	
PYMES BANESTO 2, FTA	7,91	49,91	48,71	31,28	0,00	1,38	17,02	1,18	41,52	52. ALMACENAMIENTO Y ACTIVIDADES ANEXAS AL TRANSPORTE	9,75	
Total 31/12/2022	4,59	36,74	2,44	2,51	11,12	6,00	5,65	2,51	7,74		14,41	
Total 31/12/2021	6,56	39,21	1,95	1,85	6,15	5,87	4,79	1,90	6,52		11,91	
%Variación	-30,03	-6,30	25,13	35,68	80,81	2,21	17,95	32,11	18,71		20,99	

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)	POR DEUDOR (9)	TASA DE CONCENTRACIÓN	
										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)	POR DEUDOR (9)	TASA DE CONCENTRACIÓN	
										GEOGRÁFICA	
										ÁREA	PORCENTAJE
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	13,88	0,00	0,62	0,00	0,00	2,20	2,76	7,35	2,22	CATALUÑA	20,81
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	13,41	0,00	2,45	0,00	0,00	2,02	4,15	8,34	0,22	ANDALUCÍA	22,46
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	12,87	0,00	0,36	0,53	46,38	2,54	2,86	8,83	0,09	ANDALUCÍA	19,76
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	5,87	0,00	0,03	0,00	0,00	3,03	1,78	7,03	0,07	CATALUÑA	20,44
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	14,66	0,00	1,46	0,00	0,00	3,48	4,20	8,05	0,10	ANDALUCÍA	19,58
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	14,14	0,00	0,41	0,00	0,00	4,57	2,44	7,43	0,08	ANDALUCÍA	16,97
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00	5,90	1,02	7,53	0,12	ANDALUCÍA	17,45
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	11,43	0,00	6,90	4,54	2,30	3,29	5,30	6,92	0,15	ANDALUCÍA	19,95
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	10,94	0,00	2,35	0,01	0,00	4,36	3,58	6,78	0,07	ANDALUCÍA	19,75
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACION	4,58	0,00	0,27	0,00	0,00	5,49	1,94	6,38	0,06	CATALUÑA	20,04
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	14,08	0,00	7,39	1,63	0,00	3,86	4,08	6,96	0,10	CATALUÑA	24,29
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	13,48	0,00	3,40	0,00	0,00	4,14	3,25	6,72	0,05	CATALUÑA	27,22
BBVA CONSUMO 9, FONDO DE TITULIZACION	13,70	0,00	9,84	15,83	22,62	2,61	5,71	7,98	0,25	CATALUÑA	21,48
CAIXABANK CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	7,39	18,91	3,95	14,91	16,00	11,54	13,23	2,58	2,14	CATALUÑA	36,45
CAIXABANK CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	8,70	31,37	3,77	26,10	13,62	11,55	13,23	2,91	1,21	CATALUÑA	38,30
CAIXABANK CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	19,52	0,00	3,81	42,19	13,79	2,61	5,64	7,49	2,91	CATALUÑA	29,62
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	15,18	0,00	3,61	10,38	27,67	2,56	3,63	7,68	0,98	CATALUÑA	28,98
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	1,42	0,00	0,00	0,00	0,00	2,46	2,27	7,60	0,04	CATALUÑA	17,46
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	4,15	3,14	0,00	0,00	10,19	20,04	0,03	ANDALUCÍA	23,76
DRIVER ESPAÑA SIX, FONDO DE TITULIZACION	16,27	0,00	1,83	0,11	19,37	2,28	3,96	1,35	0,18	CATALUÑA	20,84
FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2014-1	10,61	0,00	6,49	17,17	0,00	2,56	5,83	8,31	0,36	ANDALUCÍA	24,15
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	20,60	0,00	0,56	97,21	0,12	4,76	19,73	0,40	5,05	MADRID	36,66
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-1	11,18	0,00	6,36	11,02	0,00	2,49	5,41	8,27	0,27	ANDALUCÍA	23,20
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2	11,82	0,00	5,05	4,45	0,00	3,44	4,05	8,00	0,17	ANDALUCÍA	23,52

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
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	11,36	0,00	1,39	0,00	0,00	4,54	2,58	6,52	0,11	ANDALUCÍA	23,60
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	27,39	0,00	2,75	0,44	0,00	4,66	2,38	7,21	0,07	CATALUÑA	21,45
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	7,71	0,00	0,48	0,03	15,49	3,19	2,20	3,20	0,06	CATALUÑA	20,62
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	12,06	0,00	14,60	2,23	0,00	2,55	4,84	6,91	0,24	CATALUÑA	36,92
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	4,59	0,00	0,29	0,00	0,00	4,66	2,07	7,06	0,14	CATALUÑA	35,73
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO	12,50	0,00	2,50	0,90	0,00	3,55	3,44	7,86	0,12	ANDALUCÍA	22,19
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO	9,30	0,00	1,79	0,09	0,00	3,96	3,49	6,89	0,15	ANDALUCÍA	20,79
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	5,89	0,00	0,55	0,00	0,00	5,27	1,32	6,87	0,07	ANDALUCÍA	22,83
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	21,21	0,00	2,40	0,01	0,00	3,65	3,19	6,90	0,08	MADRID	18,54
WIZINK MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	6,20	4,00	0,00	0,00	10,80	18,58	0,15	MADRID	20,43
Total 31/12/2022	10,55	0,61	2,29	2,09	4,60	3,82	3,44	7,27	0,22		22,62
Total 31/12/2021	11,46	0,86	2,59	1,73	2,26	3,93	3,44	7,64	0,27		23,31
%Variación	-7,94	-29,07	-11,58	20,81	103,54	-2,80	0,00	-4,84	-18,52		-2,96

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)	POR DEUDOR (9)	TASA DE CONCENTRACIÓN	
										SECTOR	
										CNAE	PORCENTAJE
BBVA LEASING 1, FTA	0,25	0,00	96,63	6,89	0,17	2,93	16,94	2,56	7,11	43.ACTIVIDADES DE CONSTRUCCIÓN ESPECIALIZADA	13,25
BBVA LEASING 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	5,96	0,00	1,86	0,00	0,00	4,73	5,17	1,93	12,21	49.TRANSPORTE TERRESTRE Y POR TUBERÍA	15,02
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	6,90	39,31	0,91	1,77	18,49	5,01	7,21	2,49	24,15	68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS	21,61
Total 31/12/2022	6,28	14,23	1,77	0,66	6,69	4,83	5,94	2,13	16,52		17,40
Total 31/12/2021	6,74	15,51	0,64	0,39	10,86	4,64	4,76	1,74	12,58		17,37
%Variación	-6,82	-8,25	176,56	69,23	-38,40	4,09	24,79	22,41	31,32		0,17

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)	POR DEUDOR (9)	TASA DE CONCENTRACIÓN	
										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		VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	TASA DE
					FALLIDOS (5)					CONCENTRACIÓN
										POR DEUDOR (9)
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		4,46	10,36	1,87	100,00
Total 31/12/2022	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		4,46	10,36	1,87	100,00
Total 31/12/2021	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		5,43	9,40	2,56	100,00
%Variación	-	-	-	-	-		-17,86	10,21	-26,95	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 FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	TASA DE CONCENTRACIÓN POR DEUDOR (9)
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,11	0,19	24,52	31,55
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	5,65	0,59	2,37	5,41
ASF 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,08	0,12	15,04	80,28
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2,30	0,00	4,73	100,00
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	15,07	0,00	100,00
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	25,63	0,00	0,00	0,00	0,00	1,79	4,06	1,49	100,00
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	5,00	0,00	0,00	0,00
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	6,52	0,48	5,19	86,84
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,07	0,05	9,93	94,06
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,11	0,09	3,00	100,00
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	8,11	0,95	6,45	100,00
ELECNR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	7,41	8,36	0,00	58,37
FACTOR ONE, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,11	0,01	100,00
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 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	5,13	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	0,78	104,98	66,75	0,00	0,00	23,15	12,10	1,59	1,09
FTA2015, FTA	0,00	48,09	14,65	0,00	0,00	11,89	13,77	1,09	7,22
HT NEXUS, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,16	0,03	0,00	63,41
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,09	0,06	0,00	6,19
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,22	0,00	5,55	93,67
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	5,53	0,00	0,00	3,64	2,23	4,13	87,35
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,09	0,00	67,47
IM GEDESCUB, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	0,53	0,00	3,71	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

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)
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,98	3,66	2,59	100,00
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,33	3,50	2,72	100,00
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,21	0,01	33,58
IM VALL COMPANYS 1, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,22	0,00	0,00
MONDEGO 2021, FONDO DE TITULIZACION	1,78	111,33	25,99	0,61	0,00	19,33	15,21	1,12	3,27
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	8,64	0,25	4,09	48,73
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	5,00	12,38	0,00	13,49
PENSUM ESG I, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	19,45	0,79	5,90	100,00
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	2,03	0,00	0,00	13,12	1,12	7,00	1,54
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
SLF, FONDO DE TITULIZACION	15,54	0,00	77,74	0,00	0,00	0,00	0,00	2,79	6,16
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	8,15	0,00	0,00	4,74	4,74	4,44	98,35
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	5,30	0,00	4,93	100,00
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	29,21	0,00	0,00	0,00	0,00	5,70	2,20	3,26	0,25
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	0,06	0,00	98,82	0,00	0,00	0,02	8,43	0,03	99,37
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	11,34	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	35,61	0,00	0,00	0,00	0,00	11,78	0,00	3,30
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	0,00	42,94	0,00	0,00	0,00	0,00	9,63	0,00	4,11
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,39	0,21	9,52	97,53
UFASA CONSUMER FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,62	1,05	11,30	0,00
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	15,90	48,16	91,76	0,01	0,00	18,17	13,50	1,58	1,23
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	19,02	0,00	4,78	21,26	12,61	2,92	1,20	10,74	2,25
Total 31/12/2022	6,90	19,04	16,14	0,10	0,05	6,21	6,30	2,04	48,06
Total 31/12/2021	12,93	15,08	14,24	0,10	0,02	6,69	6,30	1,28	53,11
%Variación	-46,64	26,26	13,34	0,00	150,00	-7,17	0,00	59,38	-9,51

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	198.119	0	0	0	0	41.100	14	0	0	0	0,00	0,45	0,00
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	58.546	12	0	0	0	48.000	8	0	0	0	0,00	2,47	0,00
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	288.397	56	0	0	0	69.974	20	0	0	0	0,00	0,85	0,00
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	550.600	115	0	0	0	154.318	69	0	0	0	0,00	0,84	0,00
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	309.130	89	0	0	0	82.175	38	0	0	0	0,00	0,00	0,00
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	654.905	185	0	0	0	174.090	72	0	0	0	0,00	0,00	0,00
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	493.500	150	0	0	0	106.500	94	0	0	0	0,00	0,00	0,00
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	126.233	285	0	0	0	54.100	147	0	0	0	0,00	16,00	0,00
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	19.282	35	6.437	0	0	37.000	58	0	456	-6.648	0,00	0,00	0,00
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	3.145.000	57.103	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	2,67
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	2.000.000	38.014	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	2,05
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	800.084	2.002	0	0	0	274.761	928	0	0	0	0,00	8,26	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	0	0	0	0	0	184.637	622	0	0	0	0,00	2,61	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	68.409	221	0	0	0	7.540	35	0	0	0	0,00	6,15	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	0	0	0	0	0	180.730	189	0	0	0	0,00	4,49	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	239.565	595	0	0	0	23.190	81	0	0	0	0,00	3,00	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	0	0	0	0	0	200.879	216	0	0	0	0,00	2,61	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	0	0	0	0	0	252.309	667	0	0	0	0,00	7,12	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	160.974	178	0	0	0	22.000	27	0	0	0	0,00	14,99	0,00
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	1.078.850	951	0	0	0	154.121	150	0	0	0	0,00	10,00	0,00
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	266.694	1.471	0	0	0	150.016	962	0	0	0	0,00	10,00	0,00
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	276.481	1.525	0	0	0	184.320	1.182	0	0	0	0,00	10,00	0,00
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	70.075	311	0	0	0	85.500	437	0	0	0	0,00	15,43	0,00
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	114.466	490	0	0	0	82.000	401	0	0	0	0,00	5,50	0,00
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	0	0	0	0	0	6.215	5	0	0	-5.973	0,00	0,00	0,00
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	63.239	75	0	0	0	25.600	36	0	0	0	0,00	5,63	0,00
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	36.561	145	0	0	0	8.487	40	0	0	0	81,16	10,40	31,17
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	124.028	390	0	0	0	19.881	74	0	0	0	0,00	4,67	0,00
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	213.317	679	0	0	0	82.200	299	0	0	0	0,00	4,67	0,00
BANCAJA 10, FTA	0	0	0	0	0	591.868	1.527	0	24.604	0	0,00	0,00	0,00
BANCAJA 11, FTA	0	0	0	0	0	562.845	2.157	0	22.045	-10.335	0,00	0,00	0,00
BANCAJA 13, FTA	795.868	2.749	0	0	0	311.300	1.437	0	0	0	0,00	10,47	0,00
BANCAJA 8, FTA	79.817	249	0	0	0	116.400	608	0	0	0	0,00	14,31	0,00
BANCAJA 9, FTA	0	0	0	0	0	294.106	127	0	19.887	0	0,00	6,05	0,00
BANKINTER 10, FTA	0	0	0	0	0	211.633	163	0	0	0	0,00	4,78	0,00
BANKINTER 11, FTH	0	0	0	0	0	135.122	341	0	0	0	0,00	3,60	0,00
BANKINTER 13 FTA	0	0	0	0	0	312.422	1.139	0	525	0	0,00	3,30	0,00
BANKINTER 9, FTA	0	0	0	0	0	112.700	371	0	0	0	0,00	6,57	0,00
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	149.566	82	0	0	0	73.028	386	0	0	0	0,00	0,46	0,00
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	727.169	3.252	0	0	0	117.356	1.564	0	0	0	0,00	0,46	0,00
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACIÓN	939.581	2.931	0	0	0	151.583	1.187	0	0	0	0,00	0,45	0,00
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	695.933	68	0	0	0	194.180	182	0	0	0	0,00	0,47	0,00
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	1.138.658	10	0	0	0	150.000	33	0	0	0	0,00	9,70	0,00
BBVA CONSUMO 9, FONDO DE TITULIZACION	74.870	16	0	0	0	123.800	38	0	0	0	0,00	31,14	0,00
BBVA LEASING 1, FTA	0	0	0	0	0	35.502	91	0	0	-31.659	0,00	0,00	0,00
BBVA LEASING 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	411.066	328	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	18,68	0,00
BBVA RMBS 1, FTA	0	0	0	0	0	609.050	511	0	0	0	0,00	3,69	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				
BBVA RMBS 14, FTA	254.906	86	0	0	0	63.000	22	0	0	0	0,00	10,00	0,00
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	862.567	2.305	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	8,35	0,00
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	1.310.676	3.436	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	7,63	0,00
BBVA RMBS 2, FTA	0	0	0	0	0	1.141.299	940	0	0	0	0,00	2,41	0,00
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	2.036.532	5.289	0	0	0	150.000	410	0	0	0	0,00	5,72	0,00
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	11.180.655	26.689	0	0	0	372.000	933	0	0	0	0,00	5,37	0,00
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	1.358.000	2.163	0	0	0	42.000	70	0	0	0	0,00	5,00	0,00
BBVA RMBS 3, FTA	0	0	0	0	0	1.148.540	2.760	0	6.289	-93.750	0,00	0,00	0,00
BBVA RMBS 5 FTA	1.494.503	1.170	0	0	0	223.317	211	0	0	0	0,00	10,00	0,00
BBVA RMBS 9, FTA	462.095	362	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	13,03	0,00
BBVA-6 FTPYME FTA	0	0	0	0	0	12.994	10	0	0	-4.846	0,00	0,00	0,00
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	108.647	332	0	0	0	13.048	47	0	0	0	0,00	4,11	1,74
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	0	0	0	0	0	36.616	128	0	0	0	0,00	116,75	0,00
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	0	0	0	0	0	19.466	5	0	0	0	0,00	35,71	0,00
CAIXABANK CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	9.231	46	0	0	0	130.000	779	0	0	0	0,00	37,35	0,00
CAIXABANK CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	93.842	87	0	0	0	171.500	174	0	0	0	0,00	4,36	0,00
CAIXABANK CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	132.779	636	0	0	0	0,00	4,99	0,00
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	835.296	1.270	0	0	0	319.500	648	0	0	0	0,00	5,85	0,00
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	168.267	46	0	0	0	256.200	93	0	0	0	0,00	5,52	0,00
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	359.658	1.728	0	0	0	532.000	2.807	0	0	0	0,00	4,35	0,00
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	726.296	1.044	0	0	0	318.500	488	0	0	0	0,00	5,07	0,00
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	982.324	131	0	0	982.324	357.000	79	0	0	0	0,00	5,44	0,00
CAIXABANK PYMES 8, FONDO DE TITULIZACION	89.439	494	0	0	0	292.500	1.769	0	0	0	0,00	18,59	0,00
CAIXABANK PYMES 9, FONDO DE TITULIZACION	50.342	56	0	0	0	222.000	266	0	0	0	0,00	4,45	0,00
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	6.890.546	6.375	0	0	0	1.349.000	1.321	0	3.776	0	0,00	6,89	0,00
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	1.461.530	5.794	0	0	0	272.000	1.165	0	0	0	0,00	6,16	0,00
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	1.285.288	1.091	0	0	0	255.000	229	0	0	0	0,00	4,13	0,00
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	75.728	153	0	0	0	6.654	18	0	0	0	0,00	17,80	0,00
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE	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	70.705	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	2,86
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	414.000	7	0	0	0	152.000	8	0	0	0	0,00	0,00	0,00
DRIVER ESPAÑA SIX, FONDO DE TITULIZACION	170.771	130	0	0	0	14.051	11	0	0	-2.764	0,00	6,64	0,00
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	0	0	0	0	0	1.378	11	0	0	0	0,00	341,05	0,00
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	68.902	214	0	0	0	64.000	490	0	14.159	-13.987	51,84	19,94	0,00
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	56.483	50	0	0	0	41.300	69	0	8.987	-9.594	57,76	19,23	0,00
FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2014-1	21.977	15	0	0	0	95.000	204	0	0	-227	0,00	32,49	0,00
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	6.354	132	11.893	0	-11.739	14.300	138	0	5.555	-19.993	0,00	0,00	0,00
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	166.990	540	0	0	0	171.100	742	0	4.254	-1.469	0,00	3,37	0,00
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	70.695	293	25.285	0	0	570.160	2.493	114.828	10.829	-148.135	0,00	0,00	0,00
FTA UCI 11	66.466	69	0	0	0	28.900	37	0	0	0	0,00	13,37	0,00
FTA UCI 14	168.942	124	0	0	0	72.500	61	0	0	0	0,00	4,80	0,00
FTA UCI 16	290.682	288	0	0	0	136.800	169	0	0	0	0,00	3,37	0,00
FTA, UCI 15	221.815	176	0	0	0	100.840	92	0	0	0	0,00	3,55	0,00
FTA, UCI 17	266.198	214	0	0	0	112.000	106	0	0	0	0,00	2,96	0,00
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO,	8.267.800	86.954	0	0	0	0	0	0	0	0	100,00	0,00	23,54
FTH UCI 12	105.231	109	0	0	0	32.800	40	0	0	0	0,00	7,50	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	1.199.288	4.270	0	0	0	750.000	3.021	0	0	-17.901	0,00	7,70	0,00
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	333.318	432	0	0	0	72.100	99	0	0	0	0,00	2,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	307.583	399	0	0	0	98.000	67	0	0	0	0,00	2,00	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				
FONDO DE TITULIZACIÓN RMBS PRADO X	461.176	570	0	0	0	63.300	82	0	0	0	0,00	2,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO	16.492	42	0	0	0	130.100	1.217	0	0	0	0,00	10,44	0,00
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO	191.940	197	0	0	0	110.600	581	0	0	0	0,00	4,30	0,00
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO	577.900	450	0	0	-2.142	0	0	0	0	0	0,00	0,99	0,00
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	376.532	376	0	0	0	63.400	67	0	0	0	0,00	2,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO V	194.105	222	0	0	0	76.000	95	0	0	0	0,00	2,50	0,00
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO VI	213.654	265	0	0	0	77.000	105	0	0	0	0,00	2,25	0,00
FTPYPE TDA CAM 4, FTA	0	0	0	0	0	72.464	25	0	19.079	-6.200	0,00	33,21	0,00
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	3.690	3	0	0	0	28.706	41	0	1.097	-1.651	11,39	19,91	0,00
GC FTPYPE PASTOR 4, FTA	0	0	0	0	0	3.766	100	8.834	2.828	-9.320	0,00	0,00	0,00
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	86.253	78	28.479	0	0	42.700	43	0	6.365	-37.611	0,00	0,00	0,00
HIPOCAT 10, FTA	0	0	0	0	0	204.396	1.143	0	28.966	-58.738	0,00	0,00	0,00
HIPOCAT 11, FTA	0	0	0	0	0	273.980	1.458	0	32.753	-115.160	0,00	0,00	0,00
HIPOCAT 8, FTA	0	0	0	0	0	142.524	152	0	0	0	0,00	7,89	0,00
HIPOCAT 9, FTA	0	0	0	0	0	131.538	603	0	4.343	-9.083	0,00	6,08	0,00
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	429.272	1.551	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	9,43	0,00
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	496.539	1.729	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	8,16	0,00
IM ANDBANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	154.400	72	0	0	0	20.100	10	0	0	0	0,00	3,87	0,00
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	260.925	155	0	0	0	135.000	84	0	0	0	0,00	5,68	0,00
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	457.860	0	0	0	0	94.300	5	0	0	0	0,00	2,63	0,00
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	354.873	186	0	0	0	230.000	126	0	0	0	0,00	5,13	0,00
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	515.956	65	0	0	0	198.000	25	0	0	0	0,00	3,78	0,00
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	162.882	96	0	0	0	94.669	378	0	0	0	0,00	3,70	0,00
IM BCG RMBS 2, FTA	538.095	296	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	7,25	0,00
IM CAJA LABORAL 1, FTA	100.378	313	0	0	0	16.195	95	0	0	0	0,00	4,63	0,00
IM CAJA LABORAL 2, FTA	177.669	605	0	0	0	59.857	258	0	0	0	0,00	8,41	0,00
IM CAJAMAR 3, FTA	147.961	89	0	0	0	11.997	8	0	0	0	0,00	5,44	0,00
IM CAJAMAR 4, FTA	157.632	89	0	0	0	19.150	17	0	0	0	0,00	3,39	0,00
IM CAJAMAR 5, FTA	161.508	92	0	0	0	20.784	20	0	0	0	0,00	4,11	0,00
IM CAJAMAR 6, FTA	382.413	228	0	0	0	75.531	57	0	0	0	0,00	5,54	0,00
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	124.466	78	0	0	0	82.977	60	0	0	0	0,00	27,00	0,00
IM PASTOR 2, FTH	3.867	2	0	0	0	38.000	29	0	0	0	0,00	11,94	0,00
IM PASTOR 3, FTH	76.554	43	0	0	0	39.000	-117	0	141	-11.534	0,00	0,00	0,00
IM PASTOR 4, FTA	97.825	54	0	0	0	34.000	23	0	0	0	0,00	0,00	0,00
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	139.701	336	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	20,81	0,00
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	142.473	343	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	19,94	0,00
MADRID RMBS I, FTA	255.937	549	0	0	0	200.000	496	0	0	0	0,00	1,94	0,00
MADRID RMBS II, FTA	214.165	467	0	0	0	180.000	451	0	0	0	0,00	2,21	0,00
MADRID RMBS III FTA	575.088	1.275	0	0	0	270.000	752	0	27.828	0	0,00	0,00	0,00
MADRID RMBS IV, FTA	414.441	961	0	0	0	213.600	634	0	0	0	0,00	12,57	0,00
MBS BANCAJA 3, FTA	0	0	0	0	0	90.341	34	0	0	0	0,00	11,07	0,00
MBS BANCAJA 4, FTA	0	0	0	0	0	267.362	1.040	0	3.032	0	0,00	8,64	0,00
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	595.000	1	0	0	0	255.000	14	0	0	0	0,00	0,28	0,00
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	1.386.000	20	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,81	0,00
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	5.115.000	159.691	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	2,01
PYMES BANESTO 2, FTA	2.067	9	5.425	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	2.994.057	6.905	0	0	0	945.000	2.754	0	950	0	0,00	5,67	0,00
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	4.152.919	9.356	0	0	0	795.000	2.221	0	1.845	0	0,00	4,84	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 GLOBAL I, FTA	81.855	267	0	0	0	18.090	125	0	0	0	0,00	6,39	0,00
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	0	0	0	0	0	257.285	686	0	0	0	0,00	2,92	0,00
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	0	0	0	0	0	148.923	544	0	0	0	0,00	3,93	0,00
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	331.815	750	0	0	0	35.652	92	0	0	0	0,00	5,63	0,00
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	435.964	147	0	0	0	37.395	14	0	0	0	0,00	7,55	0,00
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	228.652	151	0	0	0	26.839	20	0	0	0	0,00	9,20	0,00
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	54.686	153	0	0	0	22.500	69	0	0	0	0,00	14,66	0,00
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	286.858	790	0	0	0	42.500	125	0	0	0	0,00	5,52	0,00
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	165.545	442	0	0	0	52.900	155	0	0	0	0,00	12,43	0,00
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	39.059	139	0	0	0	16.500	65	0	0	0	0,00	14,13	0,00
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	24.413	153	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	60,31	0,00
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	148.365	200	0	0	0	21.700	31	0	27	0	0,00	6,75	0,00
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	168.835	48	0	0	0	38.925	28	0	0	0	0,00	0,60	0,00
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	437.953	136	0	0	0	221.374	203	0	0	0	0,00	1,16	0,00
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE	362.642	308	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	1,50	0,00
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE	249.021	239	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	1,10	0,00
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE	707.000	849	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,99	0,00
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	1.024.779	1.072	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	2,25	0,00
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	13.487.000	2.871	0	0	0	2.263.000	610	0	4.964	0	0,00	0,76	0,00
TDA 19 - MIXTO, FTA	23.986	14	0	0	0	11.772	13	0	0	0	0,00	32,70	0,00
TDA 22 - MIXTO, FTA	16.914	4	0	0	0	32.141	9	0	0	0	0,00	5,87	0,00
TDA 24, FTA	47.870	27	0	0	0	26.600	18	0	2.160	-12.374	0,00	0,00	0,00
TDA 25, FTA	99.565	56	0	0	-29.247	14.700	11	0	1.908	-16.619	0,00	0,00	0,00
TDA 26 - MIXTO, FTA	76.498	234	0	0	0	19.142	106	0	0	0	0,00	7,66	0,00
TDA 27, FTA	143.888	28	0	0	0	51.800	13	0	5.234	-26.501	0,00	0,00	0,00
TDA 28, FTA	171.833	543	0	0	-32.943	37.350	186	0	6.760	-44.297	0,00	0,00	0,00
TDA 29, FTA	137.001	265	0	0	0	18.297	55	0	0	0	0,00	3,16	0,00
TDA 30, FTA	92.047	19	0	0	0	12.980	4	0	0	0	0,00	4,14	0,00
TDA CAJAMAR 2, FTA	87.589	22	0	0	0	8.031	2	0	0	0	0,00	7,84	3,21
TDA CAM 4, FTA	54.788	13	0	0	0	48.000	13	0	0	0	0,00	19,46	0,00
TDA CAM 5, FTA	210.062	646	0	0	0	56.000	196	0	0	0	0,00	4,13	0,00
TDA CAM 6, FTA	133.552	406	0	0	0	50.000	164	0	0	0	0,00	7,29	0,00
TDA CAM 7, FTA	199.051	375	0	0	0	92.700	188	0	0	0	0,00	3,75	0,00
TDA CAM 8, FTA	222.261	415	0	0	0	52.572	133	0	0	0	0,00	3,09	0,00
TDA CAM 9, FTA	200.557	628	0	0	0	91.500	422	0	7.980	0	0,00	1,89	0,00
TDA IBERCAJA 2, FTA	89.825	275	0	0	0	8.435	41	0	0	0	0,00	4,58	0,00
TDA IBERCAJA 3, FTA	131.138	25	0	0	0	17.477	5	0	0	0	0,00	3,36	0,00
TDA IBERCAJA 4, FTA	197.879	371	0	0	0	34.672	97	0	0	0	0,00	3,01	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				
TDA IBERCAJA 5, FTA	215.475	405	0	0	0	27.325	78	0	0	0	0,00	2,47	0,00
TDA IBERCAJA 6, FTA	339.027	745	0	0	0	44.035	138	0	0	0	0,00	5,67	0,00
TDA IBERCAJA 7, FTA	656.180	1.328	0	0	0	124.456	362	0	0	0	0,00	6,54	0,00
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	58.711	122	0	0	0	18.850	103	1.909	931	-2.465	73,88	23,72	0,00
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	3.323.572	7.336	0	0	0	570.000	1.337	0	0	0	0,00	5,04	0,00
TDA TARRAGONA 1, FTA	48.841	14	0	0	0	17.476	8	0	0	0	0,00	11,08	0,00
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	0	0	0	0	0	127.563	84	0	0	0	0,00	4,08	0,00
WIZINK MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	115.000	7	0	0	0	16.000	2	0	0	0	0,00	0,00	0,00
Subtotal BONOS 31/12/2022	113.026.063	551.518	77.519	0	-76.071	27.926.174	64.400	125.571	280.557	-718.834	6,07	4,09	1,63
PAGARÉS													
Subtotal PAGARÉS 31/12/2022	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	-
PRIVADOS													
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	10.400	44	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	1,00	0,00
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	83.000	16	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
ASF 1, FONDO DE TITULIZACION	700	0	0	0	-262	0	0	0	0	0	0,00	1,54	0,00
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	29.629	956	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACIÓN	269.447	0	0	0	-9.662	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	602.536	338	0	0	0	230.100	194	0	0	0	0,00	13,82	0,00
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACIÓN	35.000	9	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACIÓN	5.000	210	0	0	-299	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	3.100	10	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	1,00	0,00
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	30.002	16	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	700	2	0	0	-24	0	0	0	0	0	0,00	0,00	1,00
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACIÓN	33.700	2	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FACTOR ONE, FONDO DE TITULIZACION	14.904	131	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	223.500	713	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	11.079	38	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	37.660	457	0	0	-1.012	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	43.576	47	0	0	0	59.124	198	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	24.925	10	0	0	0	64.806	59	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	126.193	75	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	13.091	4	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	534.000	0	0	0	-165.487	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FTA2015, FTA	656.726	15.700	0	1.679.901	-1.881.846	524.725	0	0	0	-524.725	0,00	0,00	33,69
HT NEXUS, FONDO DE TITULIZACION	5.143	40	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	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				
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	12.775	85	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	33.279	92	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	22.778	158	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,90
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	98.750	584	0	0	-160	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	248.100	1.119	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
IM GEDESCLUB, FONDO DE TITULIZACION	500	3	0	0	-229	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	22.997	16	0	0	0	22.997	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	331.956	1.438	0	0	-256	0	0	0	0	0	0,00	0,04	0,00
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	23.700	5	0	0	-150	0	0	0	0	0	0,00	0,21	0,00
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	20.256	73	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
IM VALL COMPANYS 1, FONDO DE TITULIZACION	10.933	52	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
MONDEGO 2021, FONDO DE TITULIZACION	135.431	0	0	0	-156	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	100.080	731	0	0	-33	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	6.205	16	0	0	-186	0	0	0	0	0	0,00	0,40	0,00
PENSIUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	200	0	0	0	-101	0	0	0	0	0	0,00	1,00	0,00
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	0	3	0	0	-685	0	2	0	0	0	0,00	0,00	0,00
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	94.100	134	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
SLF, FONDO DE TITULIZACION	113.630	126	0	0	-17.340	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	83.173	351	0	458	-29.174	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	398.047	1.317	0	16.388	-102	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	141.668	0	0	0	-1.591	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	204.808	0	0	0	-9.997	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	12.863	0	0	0	-335	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	106.000	0	0	0	-4.266	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	184.216	0	0	0	-11.345	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	45.200	189	0	0	-46	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
UFASA CONSUMER FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	0	34	0	0	0	0	13	0	0	0	0,00	0,00	0,00
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	242.867	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	32.200	74	0	0	-5.673	0	0	0	0	0	0,00	1,00	0,00
Subtotal PRIVADOS 31/12/2022	5.872.723	25.425	0	1.696.747	-2.140.417	949.752	475	0	0	-524.725	0,00	2,03	2,63
Total 31/12/2022	118.898.786	576.943	77.519	1.696.747	-2.216.488	28.875.926	64.875	125.571	280.557	-1.243.559	5,82	4,01	1,67

(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			RTDO ACTIVOS NC	
	IMPORTE	% / TA (1)	IMPORTE	% / TA (2)	% COMISIONES (3)	DETERIORO	EN VENTA (4)
BONOS							
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	-458	-0,17	-636	-0,24	-0,22	-683	0
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	10.939	9,84	-12.172	-10,95	-10,89	-395	0
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	35.207	9,41	-37.110	-9,92	-9,88	-551	0
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	16.287	2,22	-10.772	-1,47	-1,30	-51	0
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	35.461	8,42	-39.133	-9,29	-9,26	336	0
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	64.385	7,17	-63.847	-7,11	-7,10	-2.014	0
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	8.148	1,29	-8.133	-1,29	-1,19	-15	0
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	-700	-0,33	-140	-0,07	-0,05	0	0
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	-9	-0,01	-107	-0,18	-0,07	771	1
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	200	0,01	-211	-0,01	0,00	0	0
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	74	0,00	-75	0,00	0,00	0	0
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	-10.304	-0,88	-423	-0,04	-0,03	6.543	0
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	-343	-0,18	-113	-0,06	-0,04	87	1
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	-54	-0,07	-113	-0,14	-0,09	97	0
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	-134	-0,07	-115	-0,06	-0,04	12	3
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	-342	-0,12	-168	-0,06	-0,04	196	2
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	-199	-0,10	-170	-0,08	-0,04	1.873	4
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	-1.095	-0,40	-144	-0,05	-0,03	1.484	6
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	-305	-0,14	-152	-0,07	-0,04	2.350	31
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	532	0,04	-12.121	-0,89	-0,88	11.621	-32
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	163	0,04	-217	-0,05	-0,03	3.808	15
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	-490	-0,10	-190	-0,04	-0,03	2.610	0
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	674	0,37	-2.190	-1,20	-1,16	1.754	0
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	988	0,47	-2.364	-1,11	-1,10	1.376	0
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	-48	-17,76	-66	-24,55	-14,14	0	0
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	905	0,93	-103	-0,11	-0,06	96	0
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	103	0,20	-80	-0,16	-0,05	292	0
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	703	0,46	-859	-0,57	-0,54	424	0
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	206	0,07	-142	-0,05	-0,03	3.975	0
BANCAJA 10, FTA	1.303	0,21	-507	-0,08	-0,03	-260	-537
BANCAJA 11, FTA	849	0,15	-455	-0,08	-0,03	-21	-364
BANCAJA 13, FTA	3.024	0,24	-720	-0,06	-0,02	-30.355	-1.442
BANCAJA 8, FTA	86	0,04	-186	-0,09	-0,05	-1.116	-35
BANCAJA 9, FTA	-455	-0,14	-233	-0,07	-0,04	-167	-222
BANKINTER 10, FTA	-526	-0,24	-104	-0,05	-0,03	-3	0
BANKINTER 11, FTH	-420	-0,30	-91	-0,06	-0,04	0	-3
BANKINTER 13 FTA	-602	-0,18	-161	-0,05	-0,03	137	-95
BANKINTER 9, FTA	-42	-0,03	-85	-0,07	-0,05	0	1
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	15.790	6,96	-13.669	-6,02	-6,00	-2.121	0
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	50.168	5,54	-42.618	-4,70	-4,69	-7.550	0
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACIÓN	22.098	1,92	-21.324	-1,85	-1,85	-774	0
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	67.689	7,55	-44.402	-4,95	-4,95	-23.287	0
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	102.874	7,21	-76.385	-5,36	-5,35	-26.489	0
BBVA CONSUMO 9, FONDO DE TITULIZACION	18.766	7,02	-18.403	-6,89	-6,87	-363	0
BBVA LEASING 1, FTA	-1.506	-38,09	-78	-1,97	-1,52	1.967	-121
BBVA LEASING 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	9.279	1,10	-4.622	-0,55	-0,54	-4.554	-103
BBVA RMBS 1, FTA	2.716	0,42	-442	-0,07	-0,03	-98	252
BBVA RMBS 14, FTA	2.713	0,77	-2.823	-0,81	-0,79	0	0
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	15.459	1,34	-15.452	-1,33	-1,33	-7	0
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	6.561	0,40	-6.548	-0,40	-0,40	-13	0
BBVA RMBS 2, FTA	6.248	0,51	-1.034	-0,09	-0,03	170	101
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	23.247	0,89	-23.191	-0,89	-0,89	-56	0
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	62.096	0,49	-61.804	-0,49	-0,49	-292	0
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	811	0,05	-811	-0,05	-0,05	0	0
BBVA RMBS 3, FTA	5.464	0,51	-878	-0,08	-0,03	-210	-143
BBVA RMBS 5 FTA	-7.874	-0,41	-740	-0,04	-0,02	580	160
BBVA RMBS 9, FTA	2.419	0,36	-2.589	-0,39	-0,38	187	-17
BBVA-6 FTPYME FTA	-727	-8,89	-246	-3,01	-0,64	6	-244
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	1.278	0,95	-2.228	-1,65	-1,62	-3	0
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	39	0,05	-283	-0,34	-0,33	-84	0
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	261	0,80	-1.218	-3,72	-3,63	24	0
CAIXABANK CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	-1.367	-0,71	-2.073	-1,08	-1,04	2.872	0
CAIXABANK CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	7.416	2,67	-17.633	-6,35	-6,33	10.217	0
CAIXABANK CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	9.053	6,41	-15.184	-10,75	-10,70	6.130	0
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	91.404	7,39	-64.843	-5,25	-5,24	-26.561	0
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	4.690	1,05	-3.565	-0,79	-0,78	-1.125	0
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	6.758	0,72	-9.685	-1,03	-1,03	2.927	0
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	9.680	0,88	-3.699	-0,34	-0,33	-5.905	0
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	15.016	1,06	-3.663	-0,26	-0,25	-11.353	0
CAIXABANK PYMES 8, FONDO DE TITULIZACION	-1.428	-0,31	-1.252	-0,27	-0,26	2.751	0
CAIXABANK PYMES 9, FONDO DE TITULIZACION	2.866	1,01	-2.732	-0,96	-0,94	-1.652	0

Miles de euros

FONDO	MARGEN DE INTERESES		GASTOS DE EXPLOTACIÓN			RTDO ACTIVOS NC	
	IMPORTE	% / TA (1)	IMPORTE	% / TA (2)	% COMISIONES (3)	DETERIORO	EN VENTA (4)
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	-76	0,00	-45.759	-0,52	-0,52	24.593	0
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	11.547	0,63	-18.301	-0,99	-0,99	4.361	0
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	12.455	0,78	-15.874	-0,99	-0,99	1.793	0
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	-374	-0,37	-114	-0,11	-0,07	0	0
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE	15.378	1,23	-15.378	-1,23	-1,23	0	0
CEDULAS TDA 6, FTA	23	0,00	-7	0,00	0,00	0	0
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	108.809	16,52	-93.089	-14,13	-14,12	-15.720	0
DRIVER ESPAÑA SIX, FONDO DE TITULIZACION	13.730	5,94	-13.991	-6,05	-6,03	-43	0
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	-258	-2,88	-73	-0,81	-0,37	-269	-200
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	-274	-0,20	-162	-0,12	-0,08	2.170	0
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	-240	-0,24	-125	-0,12	-0,09	787	0
FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2014-1	2.223	1,90	-2.782	-2,38	-2,33	332	0
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	-287	-4,03	-119	-1,67	-1,32	693	-8
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	1.589	0,45	-289	-0,08	-0,03	-1.144	-848
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	3.040	0,46	-646	-0,10	-0,03	-2.266	-2.179
FTA UCI 11	1.113	0,99	-3.443	-3,06	-3,05	569	1.761
FTA UCI 14	4.087	1,52	-19.909	-7,39	-7,38	3.845	11.977
FTA UCI 16	7.476	1,65	-29.849	-6,57	-6,56	9.674	25.223
FTA, UCI 15	5.030	1,49	-22.606	-6,71	-6,70	3.717	13.859
FTA, UCI 17	5.509	1,39	-21.828	-5,50	-5,49	6.675	16.402
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	56.301	0,63	-2.122	-0,02	-0,01	0	0
FTH UCI 12	2.061	1,34	-7.926	-5,17	-5,15	882	4.983
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	34.411	1,77	-31.397	-1,62	-1,62	-12.368	-14
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	7.634	1,64	-7.190	-1,54	-1,51	72	0
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	6.984	1,67	-6.131	-1,47	-1,45	27	-182
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO X	4.592	0,81	-8.071	-1,43	-1,27	-169	0
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO	6.657	4,48	-6.396	-4,30	-4,27	-261	0
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO	21.083	6,81	-19.045	-6,16	-6,14	-2.038	0
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO	31.380	5,01	-25.021	-4,00	-3,99	-5.170	0
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	8.706	1,82	-7.499	-1,57	-1,55	46	0
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO V	3.115	1,12	-3.151	-1,14	-1,12	92	-149
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO VI	2.993	0,96	-2.961	-0,95	-0,94	190	-104
FTPYME TDA CAM 4, FTA	-732	-0,86	-374	-0,44	-0,03	55	-20
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	-641	-1,74	-83	-0,23	-0,13	78	-14
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	-386	-6,10	-261	-4,12	-0,52	502	-84
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	-102	-0,08	-849	-0,67	-0,13	1.489	175
HIPOCAT 10, FTA	-890	-0,50	-327	-0,18	-0,04	340	-25
HIPOCAT 11, FTA	-901	-0,46	-427	-0,22	-0,05	2.359	-118
HIPOCAT 8, FTA	1.056	0,61	-1.736	-1,01	-0,90	854	-183
HIPOCAT 9, FTA	-124	-0,10	-222	-0,17	-0,05	1.020	34
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	-964	-0,15	-637	-0,10	-0,09	-26	0
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	-393	-0,06	-845	-0,13	-0,12	-357	0
IM ANDBANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	381	0,22	-464	-0,27	-0,07	0	0
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	4.059	0,97	-4.057	-0,97	-0,95	-3	0
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	8.438	1,48	-8.459	-1,49	-1,48	21	0
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACION	13.000	2,11	-12.189	-1,98	-1,96	-811	0
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	12.397	1,67	-10.805	-1,45	-1,37	-1.592	0
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	3.907	1,44	-3.670	-1,35	-1,31	693	-931
IM BCG RMBS 2, FTA	721	0,10	-721	-0,10	-0,09	0	0
IM CAJA LABORAL 1, FTA	449	0,37	-449	-0,37	-0,34	0	0
IM CAJA LABORAL 2, FTA	819	0,30	-826	-0,31	-0,29	7	0
IM CAJAMAR 3, FTA	1.003	0,56	-1.314	-0,74	-0,72	311	0
IM CAJAMAR 4, FTA	872	0,47	-876	-0,47	-0,45	4	0
IM CAJAMAR 5, FTA	176	0,09	-176	-0,09	-0,07	0	0
IM CAJAMAR 6, FTA	-629	-0,13	-158	-0,03	-0,02	35	0
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	223	0,08	-220	-0,08	-0,06	-3	0

Miles de euros

FONDO	MARGEN DE INTERESES		GASTOS DE EXPLOTACIÓN			RTDO ACTIVOS NC	
	IMPORTE	% / TA (1)	IMPORTE	% / TA (2)	% COMISIONES (3)	DETERIORO	EN VENTA (4)
IM PASTOR 2, FTH	14	0,03	-71	-0,14	-0,04	19	19
IM PASTOR 3, FTH	-151	-0,14	-515	-0,47	-0,05	56	-314
IM PASTOR 4, FTA	104	0,08	-622	-0,45	-0,04	141	-616
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	1.189	0,36	-308	-0,09	-0,04	-97	91
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	1.287	0,41	-356	-0,11	-0,04	-168	138
MADRID RMBS I, FTA	1.691	0,32	-639	-0,12	-0,03	-120	143
MADRID RMBS II, FTA	492	0,11	-589	-0,13	-0,03	-588	111
MADRID RMBS III, FTA	755	0,08	-1.064	-0,11	-0,02	-2.057	453
MADRID RMBS IV, FTA	-4.627	-0,60	-775	-0,10	-0,03	-1.085	210
MBS BANCAJA 3, FTA	144	0,15	-108	-0,11	-0,06	-8	-51
MBS BANCAJA 4, FTA	517	0,17	-207	-0,07	-0,03	-87	-185
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	52.824	6,11	-37.924	-4,39	-4,37	-14.323	0
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	73.490	4,86	-73.325	-4,84	-4,84	-2.680	0
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	-2	0,00	-6	0,00	0,00	0	0
PYMES BANESTO 2, FTA	-529	-6,12	-121	-1,40	-0,02	28	-1.402
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	19.668	0,50	-13.613	-0,34	-0,34	-5.860	-195
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	13.730	0,28	-2.884	-0,06	-0,06	-3.703	-75
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA	255	0,24	-194	-0,18	-0,14	11	-60
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	1.437	0,51	-1.392	-0,50	-0,47	26	-11
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	547	0,34	-559	-0,35	-0,31	0	12
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	1.040	0,26	-1.288	-0,32	-0,31	0	4
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	1.744	0,33	-1.747	-0,33	-0,32	0	1
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	489	0,17	-558	-0,19	-0,18	0	10
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	11	0,01	-182	-0,20	-0,15	0	0
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	2.688	0,77	-2.683	-0,77	-0,75	-5	0
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	305	0,12	-576	-0,23	-0,21	0	0
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	86	0,13	-173	-0,27	-0,20	0	0
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	-227	-0,45	-72	-0,14	-0,05	0	0
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	1.026	0,56	-1.065	-0,58	-0,55	0	0
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	13.821	6,29	-187	-0,09	-0,05	-7.147	0
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	8.560	1,24	-8.091	-1,18	-1,17	-469	0
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE	32.877	8,52	-30.119	-7,80	-7,78	-2.758	0
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE	18.067	6,80	-16.896	-6,36	-6,32	-1.333	0
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE	5.791	0,77	-2.193	-0,29	-0,02	-3.777	0
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	72.380	6,58	-56.339	-5,12	-5,12	-10.911	0
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	87.631	0,54	-64.617	-0,39	-0,39	-18	0
TDA 19 - MIXTO, FTA	-150	-0,31	-94	-0,19	-0,18	0	0
TDA 22 - MIXTO, FTA	-368	-0,62	-394	-0,67	-0,20	-122	-4
TDA 24, FTA	-1.379	-2,09	-729	-1,11	-0,22	-482	65
TDA 25, FTA	12	0,02	-1.280	-1,80	-0,09	-629	48
TDA 26 - MIXTO, FTA	143	0,14	-395	-0,39	-0,35	0	0
TDA 27, FTA	2.010	1,09	-1.035	-0,56	-0,04	-422	10
TDA 28, FTA	68	0,05	-1.471	-1,02	-0,07	-797	35
TDA 29, FTA	538	0,33	-486	-0,30	-0,28	3	0
TDA 30, FTA	422	0,38	-642	-0,58	-0,54	0	0
TDA CAJAMAR 2, FTA	-303	-0,27	-1.268	-1,14	-1,10	0	0
TDA CAM 4, FTA	633	0,46	-1.428	-1,04	-0,90	-2	0
TDA CAM 5, FTA	1.652	0,52	-2.052	-0,65	-0,36	-293	137
TDA CAM 6, FTA	1.068	0,46	-1.007	-0,43	-0,03	-464	34
TDA CAM 7, FTA	1.981	0,57	-1.164	-0,34	-0,06	-379	42
TDA CAM 8, FTA	1.514	0,48	-953	-0,30	-0,02	-326	132
TDA CAM 9, FTA	1.373	0,41	-1.142	-0,34	-0,02	-278	85
TDA IBERCAJA 2, FTA	473	0,46	-101	-0,10	-0,07	95	0
TDA IBERCAJA 3, FTA	556	0,37	-1.101	-0,73	-0,71	361	0
TDA IBERCAJA 4, FTA	711	0,30	-3.631	-1,53	-1,52	1.049	0
TDA IBERCAJA 5, FTA	866	0,35	-2.670	-1,08	-1,07	611	0
TDA IBERCAJA 6, FTA	762	0,19	-142	-0,03	-0,03	1.858	0
TDA IBERCAJA 7, FTA	1.457	0,18	-3.166	-0,40	-0,40	489	0
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	-329	-0,42	-107	-0,14	-0,10	0	0
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	22.661	0,54	-634	-0,02	-0,01	-54	0
TDA TARRAGONA 1, FTA	123	0,17	-343	-0,46	-0,41	2	0
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	753	0,55	-1.107	-0,81	-0,76	59	293
WIZINK MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	19.453	9,53	-90.352	-44,25	-44,21	70.899	0
Subtotal BONOS 2022	1.597.649	1,05	-1.583.082	-1,04	-1,02	-40.141	65.734
Subtotal BONOS 2021	1.842.921	1,22	-1.618.373	-1,07	-1,04	-210.158	-17.761
%Variación	-13,31	-13,65	-2,18	-2,56	-2,14	-80,90	-

Miles de euros

FONDO	MARGEN DE INTERESES		GASTOS DE EXPLOTACIÓN			RTDO ACTIVOS NC	
	IMPORTE	% / TA (1)	IMPORTE	% / TA (2)	% COMISIONES (3)	DETERIORO	EN VENTA (4)
PAGARES							
Subtotal PAGARÉS 2022	0	0,00	0	0,00	0,00	0	0
Subtotal PAGARÉS 2021	0	0,00	0	0,00	0,00	0	0
%Variación	-	-	-	-	-	-	-
PRIVADOS							
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	1.648	15,73	-1.595	-15,23	-12,97	-13	0
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	210	0,21	-299	-0,30	-0,11	-39	0
ASF 1, FONDO DE TITULIZACION	-1	-0,20	-261	-54,78	-27,87	0	0
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	0	0,00	0	0,00	0,00	0	0
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACION	-4	0,00	-704	-0,27	-0,05	11.412	0
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	-423	-0,04	423	0,04	0,05	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	120	0,62	-448	-2,31	-0,67	0	0
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACION	148	4,67	-294	-9,24	-2,63	0	0
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	853	2,84	-1.043	-3,47	-3,14	0	0
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	-2	-0,21	-47	-5,84	-3,86	0	0
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE	7.876	10,25	-5.858	-7,62	-7,61	0	0
FACTOR ONE, FONDO DE TITULIZACION	-111	-0,70	-356	-2,25	-0,51	0	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	5.964	1,91	-7.335	-2,35	-2,01	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	104	0,79	-156	-1,19	-0,83	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	-674	-1,53	-286	-0,65	-0,52	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	833	0,72	-1.032	-0,89	-0,83	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	531	0,53	-847	-0,85	-0,81	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	1.575	1,04	-2.022	-1,34	-1,30	0	0
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	0	0,00	-129	-0,86	-0,02	0	0
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	881	0,16	-171	-0,03	0,00	-166.368	0
FTA2015, FTA	-224.896	-47,02	-16.183	-3,38	-2,23	-13.074	0
HT NEXUS, FONDO DE TITULIZACION	1.870	32,59	-1.870	-32,59	-32,48	0	0
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	475	3,52	-475	-3,52	-2,95	0	0
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	1.682	4,83	-1.577	-4,53	-3,48	0	0
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	1.940	8,06	-1.606	-6,67	-5,15	-334	0
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	610	0,61	-919	-0,93	-0,61	0	0
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	1.285	0,51	-1.285	-0,51	-0,47	0	0
IM GEDESCLUB, FONDO DE TITULIZACION	-4	-0,79	-224	-40,85	-24,31	0	0
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	1.086	2,07	-1.232	-2,35	-1,79	-465	0
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	1.319	0,40	-1.052	-0,32	-0,31	0	0
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	119	0,50	-119	-0,50	-0,47	0	0
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	313	1,53	-313	-1,53	-1,33	0	0
IM VALL COMPANYS 1, FONDO DE TITULIZACION	182	1,64	-223	-2,01	-1,05	0	0
MONDEGO 2021, FONDO DE TITULIZACION	2.699	1,99	-1.377	-1,02	-0,90	-476	0
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	-15	-0,01	-80	-0,08	-0,03	0	0
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	13	0,22	-199	-3,27	-1,51	0	0
PENSIUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	0	0,43	-161	-144,03	-72,22	0	0
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	253	2,02	-869	-6,93	-0,81	-68	0
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE	6.528	3,22	-6.528	-3,22	-3,21	0	0
SLF, FONDO DE TITULIZACION	6.500	6,55	-2.800	-2,82	-1,75	-3.587	0
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	8.380	15,27	-581	-1,06	-0,83	-20.182	0
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	-1	0,00	-101	-0,02	-0,02	0	0
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	10.930	2,68	-11.459	-2,81	-2,79	0	0
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	1.816	1,29	-436	-0,31	-0,17	-233	0
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	-8	0,00	-865	-0,44	-0,08	-593	0
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	-1	-0,01	-74	-0,59	-0,41	4.523	0
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	869	0,85	-55	-0,05	-0,03	-5.080	0
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	9.790	5,64	-4.333	-2,50	-1,81	-16.801	0
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	36	0,08	-82	-0,18	-0,15	0	0
UFASA CONSUMER FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	8.584	6,91	-6.248	-5,03	-4,99	-2.337	0
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	53.940	15,84	-16.627	-4,88	-3,28	1.540	0
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	661	2,47	-390	-1,46	-0,93	-711	0
Subtotal PRIVADOS 2022	-83.513	-1,23	-102.805	-1,51	-1,20	-212.886	0
Subtotal PRIVADOS 2021	-82.688	-1,18	-74.951	-1,07	-0,78	-15.976	0
%Variación	1,00	3,97	37,16	41,20	54,14	1.232,54	-
Total 2022							
Total 2021							
%Variación							
	-13,98	-14,19	-0,44	-0,69	-0,29	11,89	-

(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

	% VARIACIÓN	INT ACTIVOS	INT	OTROS	TIPO INT DCHOS	TIPO INTERÉS
FONDO	MI (1)	TITULIZADOS	OBLIGACIONES	INTERESES	CREDITO (2)	OBLIGACIONES
BONOS						
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	22.381	-22.782	-57	7,35	0,00
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	-52,96	12.530	-1.346	-37	8,34	0,90
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-20,71	38.915	-3.712	-207	8,83	0,89
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	-	25.671	-6.590	62	7,03	0,38
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	-35,77	38.378	-4.893	-45	8,05	2,91
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	71,95	68.057	-8.084	-47	7,43	2,77
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	-	14.101	-4.492	7	7,53	3,66
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	0,00	364	-971	-93	0,15	0,91
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	95,85	974	-333	-167	1,46	1,19
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	-8,23	191.225	-191.011	-14	4,21	4,50
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	0,00	75.074	-75.000	0	3,75	3,75
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	20,80	7.196	-14.613	-3.266	0,40	1,21
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	-7,30	406	-754	-137	0,16	0,17
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	72,63	299	-307	-101	0,31	0,17
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	28,38	465	-752	-66	0,19	1,16
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	32,01	833	-1.116	-198	0,23	0,53
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	62,19	832	-962	-231	0,32	1,23
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	-70,19	530	-1.128	-812	0,16	0,58
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	-117,29	716	-885	-208	0,29	1,34
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	0,00	5.116	-5.390	-756	0,33	0,63
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	1.030,13	2.154	-2.614	-342	0,44	0,07
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	-365,30	1.667	-2.929	-376	0,29	0,08
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	6.106,27	1.803	-844	-508	0,69	0,09
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	114,83	1.646	-971	-227	0,56	0,07
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	-546,30	0	-43	-5	0,00	0,09
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	0,00	1.471	-399	-25	0,73	1,11
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	73,90	260	-278	-50	0,44	0,57
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	0,00	1.050	-588	-43	0,45	0,31
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	0,00	3.617	-1.090	-109	0,83	0,14
BANCAJA 10, FTA	121,60	4.074	-3.875	-62	0,66	0,61
BANCAJA 11, FTA	55,78	3.269	-3.998	-99	0,58	0,67
BANCAJA 13, FTA	75,10	8.550	-6.620	-3.261	0,73	0,57
BANCAJA 8, FTA	0,00	1.585	-1.889	19	0,87	0,89
BANCAJA 9, FTA	37,33	2.185	-3.086	-30	0,71	0,77
BANKINTER 10, FTA	46,38	889	-1.414	-7	0,40	0,59
BANKINTER 11, FTH	44,15	405	-819	-7	0,29	0,55
BANKINTER 13 FTA	56,88	1.025	-1.732	-12	0,32	0,51
BANKINTER 9, FTA	82,20	509	-437	-123	0,43	0,35
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	-43,24	18.399	-2.526	-83	6,92	0,88
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-16,02	62.767	-13.141	-668	6,78	1,32
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	39.421	-10.529	134	6,38	1,64
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	-31,88	75.534	-7.814	-31	6,96	0,67
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	-11,56	105.284	-1.063	-1.347	6,72	0,06
BBVA CONSUMO 9, FONDO DE TITULIZACION	-26,55	21.496	-2.360	-370	7,98	0,83
BBVA LEASING 1, FTA	-41,81	180	-296	-1.261	2,56	0,78
BBVA LEASING 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	-29,28	17.838	-4.610	-3.949	1,93	0,70
BBVA RMBS 1, FTA	-29,49	4.295	-2.756	-1.153	0,65	0,41
BBVA RMBS 14, FTA	-47,49	4.168	-1.444	-11	1,24	0,41
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	-6,05	19.948	-3.743	-746	1,75	0,39
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	-8,21	29.699	-6.987	-556	1,88	0,49
BBVA RMBS 2, FTA	-21,68	7.926	-4.794	-1.029	0,65	0,38
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	72,70	33.708	-8.388	70	1,48	0,36
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	-	99.690	-42.399	777	1,07	0,45
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	-	1.880	-2.232	3	1,45	1,85
BBVA RMBS 3, FTA	-18,79	8.591	-5.131	-1.158	0,80	0,42
BBVA RMBS 5 FTA	-28,60	13.269	-8.919	-12.224	0,74	0,48
BBVA RMBS 9, FTA	6,89	5.124	-2.178	-527	0,81	0,43
BBVA-6 FTPYME FTA	-34,13	58	-94	-671	1,99	0,66
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	10,68	2.129	-504	-75	1,64	0,50
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	-21,25	703	-604	-181	1,64	1,65
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	-45,29	441	-164	-64	1,99	0,90
CAIXABANK CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	3.535	-2.181	-2.721	2,58	2,92
CAIXABANK CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	-62,20	11.012	-2.855	-741	2,91	2,96
CAIXABANK CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	-56,78	13.894	-4.359	-482	7,49	2,50
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	-44,10	108.174	-12.331	-4.440	7,68	0,82
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	-23,78	11.318	-5.012	-1.617	2,49	0,90
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	-60,25	20.660	-11.606	-2.297	2,44	2,69
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	-23,75	22.109	-9.312	-3.116	2,30	0,77
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	-24,44	25.281	-5.720	-4.545	1,97	0,35

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 8, FONDO DE TITULIZACION	0,00	8.341	-6.063	-3.707	2,49		2,84
CAIXABANK PYMES 9, FONDO DE TITULIZACION	-62,05	7.747	-4.059	-823	2,58		3,27
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	78.767	-49.484	-29.359	1,46		2,59
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	-49,58	27.155	-9.801	-5.808	1,96		1,90
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	-46,69	25.291	-9.339	-3.497	1,99		2,57
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	-538,01	169	-394	-149	0,21		0,60
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	21.994	-6.640	24	7,60		3,82
CEDULAS TDA 6, FTA	13,55	116.375	-116.375	23	3,88		3,88
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	-1,53	110.307	-1.400	-97	20,04		0,24
DRIVER ESPAÑA SIX, FONDO DE TITULIZACION	120,54	4.508	-1.586	10.051	1,35		1,00
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	-53,57	52	-39	-273	3,36		2,49
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	-5,56	1.927	-1.543	-33	1,83		2,29
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	-47,12	1.319	-1.394	-25	1,83		3,37
FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2014-1	-74,91	9.313	-7.520	430	8,31		5,60
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	-198,96	283	-827	-2	0,40		3,55
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	19,56	1.485	-1.877	37	1,09		1,79
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	2,43	3.271	-3.687	26	1,08		1,67
FTA UCI 11	-20,44	1.643	-480	-50	2,23		2,34
FTA UCI 14	-25,26	5.176	-1.070	-19	2,27		2,28
FTA UCI 16	-1,61	9.733	-2.311	54	2,57		2,41
FTA, UCI 15	-17,69	6.405	-1.414	39	2,54		2,29
FTA, UCI 17	-15,61	7.502	-1.833	151	2,67		2,34
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	2,68	202.699	-140.713	-5.685	1,87		1,67
FTH UCI 12	-24,86	2.693	-621	-11	2,26		2,28
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	-34,60	43.028	-9.882	1.265	2,80		1,84
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	-15,72	9.736	-3.201	516	1,40		2,77
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	30,62	9.173	-2.840	762	1,47		2,43
FONDO DE TITULIZACIÓN RMBS PRADO X	-	7.834	-3.942	278	1,71		2,80
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-1	-59,22	13.539	-6.882	0	8,27		4,23
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2	-39,78	28.782	-7.699	0	8,00		2,25
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	261,40	34.578	-4.783	1.163	6,52		2,80
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	528,14	9.969	-3.467	1.171	1,60		2,78
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO V	-28,75	4.537	-1.459	37	0,45		2,48
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO VI	-24,67	5.700	-1.675	60	0,80		2,54
FTPYME TDA CAM 4, FTA	10,82	373	-1.449	94	0,72		2,02
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	-45,68	443	-699	-246	1,45		1,74
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	-50,39	114	-308	-195	2,43		2,35
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	-153,98	1.291	-1.057	-17	0,89		1,55
HIPOCAT 10, FTA	-150,70	1.691	-2.862	-5	0,95		0,92
HIPOCAT 11, FTA	-158,91	2.161	-3.146	-7	1,12		0,78
HIPOCAT 8, FTA	-5,80	1.868	-615	-42	1,21		0,39
HIPOCAT 9, FTA	37,06	1.048	-1.431	-26	0,87		0,85
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	0,00	2.429	-1.975	-1.418	0,34		0,37
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	0,00	3.319	-2.305	-1.407	0,44		0,45
IM ANDBANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	-	1.092	-613	-98	1,44		0,00
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	-24,30	5.716	-1.576	-81	2,33		0,00
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	2,14	8.756	-191	-126	2,38		0,03
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	-1,56	17.712	-4.329	-382	3,18		2,14
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	-	15.957	-3.193	-367	2,86		0,50
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	-21,30	7.042	-3.021	-113	3,15		0,97
IM BCG RMBS 2, FTA	-52,89	3.665	-2.288	-656	1,84		2,20
IM CAJA LABORAL 1, FTA	491,15	718	-645	-2	1,86		1,83
IM CAJA LABORAL 2, FTA	1.493,91	1.430	-1.304	-97	1,89		1,92
IM CAJAMAR 3, FTA	154,47	1.091	-665	1	1,41		2,25
IM CAJAMAR 4, FTA	280,44	1.297	-936	3	2,15		2,31
IM CAJAMAR 5, FTA	-75,26	1.270	-1.056	-38	1,24		2,47
IM CAJAMAR 6, FTA	0,00	2.570	-3.092	-107	1,34		2,61
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	-74,27	1.032	-1.021	-116	1,40		2,17
IM PASTOR 2, FTH	-86,06	322	-423	-25	1,07		2,99
IM PASTOR 3, FTH	0,00	949	-491	-240	2,00		2,29
IM PASTOR 4, FTA	-73,02	1.088	-626	-150	1,70		2,35
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	-0,29	2.640	-646	-1.179	0,74		0,56
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	-2,50	2.296	-657	-985	0,69		0,56
MADRID RMBS I, FTA	249,18	4.817	-2.065	-1.268	0,95		0,54
MADRID RMBS II, FTA	91,28	4.150	-1.863	-1.376	0,93		0,56
MADRID RMBS III FTA	-23,26	7.655	-4.374	-2.726	0,82		0,61
MADRID RMBS IV, FTA	-27,79	5.094	-3.723	-6.193	0,74		0,68
MBS BANCAJA 3, FTA	242,86	738	-722	13	0,81		0,71
MBS BANCAJA 4, FTA	-14,55	1.874	-1.966	0	0,69		0,68
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	2,25	54.268	-1.393	-51	7,21		0,16
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	355,03	48.493	-720	25.716	3,20		0,05

Miles de euros

FONDO	% VARIACIÓN MI (1)	INT ACTIVOS TITULIZADOS	INT OBLIGACIONES	OTROS INTERESES	TIPO INT DCHOS CREDITO (2)	TIPO INTERÉS OBLIGACIONES	
						(3)	
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	91,84	217.868	-217.868	-2	4,25		4,25
PYMES BANESTO 2, FTA	-42,20	133	-48	-596	1,18		2,58
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	-40,24	34.867	-15.199	0	1,48		1,96
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	8,94	31.206	-17.469	-7	1,33		1,91
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA	14,86	928	-663	6	0,93		0,60
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	29,81	2.644	-1.358	-8	0,99		0,48
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	52,37	1.452	-830	4	0,95		0,51
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	-16,80	3.248	-1.658	-210	0,84		0,41
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	65,94	4.146	-2.181	-393	0,82		0,42
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	27,01	2.252	-1.251	-477	0,83		0,45
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	-96,63	572	-368	-193	0,71		0,44
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	-28,59	4.711	-1.679	-344	1,38		0,48
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	-69,04	1.729	-995	-429	0,75		0,42
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	-65,46	471	-253	-132	0,81		0,42
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	-152,22	418	-391	-254	1,14		1,48
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	-39,68	2.150	-903	-221	1,19		0,49
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	-49,00	17.992	-3.373	-893	6,91		1,10
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	-	23.873	-11.313	98	7,06		3,27
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	-16,31	34.807	-3.429	0	7,86		2,55
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-34,58	20.517	-3.002	574	6,89		2,89
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	-	8.601	-2.774	-32	6,87		3,60
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	-2,56	84.515	-14.029	1.041	6,90		2,90
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	0,12	194.655	-90.427	-407	1,31		0,76
TDA 19 - MIXTO, FTA	-89,39	823	-381	-135	2,02		1,06
TDA 22 - MIXTO, FTA	6,45	714	-507	-55	1,18		1,12
TDA 24, FTA	-29,61	24	-405	-9	1,45		0,64
TDA 25, FTA	-97,44	520	-504	-4	1,34		0,56
TDA 26 - MIXTO, FTA	0,00	900	-619	7	0,90		0,72
TDA 27, FTA	81,37	3.203	-1.028	-165	0,93		0,65
TDA 28, FTA	-92,22	1.319	-1.228	-24	1,30		0,70
TDA 29, FTA	285,02	1.226	-782	6	0,73		0,62
TDA 30, FTA	146,87	771	-658	7	0,62		0,75
TDA CAJAMAR 2, FTA	0,00	2.269	-411	-14	2,88		0,53
TDA CAM 4, FTA	300,75	1.053	-393	-148	0,90		0,46
TDA CAM 5, FTA	120,75	2.149	-1.062	-96	0,82		0,48
TDA CAM 6, FTA	136,01	1.526	-755	-125	0,79		0,51
TDA CAM 7, FTA	117,84	2.296	-1.102	-74	0,77		0,49
TDA CAM 8, FTA	233,72	2.142	-1.300	-13	0,76		0,57
TDA CAM 9, FTA	122,37	2.077	-1.855	-6	0,74		0,73
TDA IBERCAJA 2, FTA	505,74	733	-457	6	0,70		0,53
TDA IBERCAJA 3, FTA	0,00	1.054	-701	11	0,68		0,58
TDA IBERCAJA 4, FTA	0,00	1.641	-1.158	9	0,64		0,60
TDA IBERCAJA 5, FTA	0,00	1.578	-1.136	11	0,63		0,57
TDA IBERCAJA 6, FTA	0,00	2.767	-2.049	-238	0,65		0,63
TDA IBERCAJA 7, FTA	0,00	4.051	-4.384	-266	0,53		0,68
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	29,86	892	-994	4	1,36		1,22
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	35,42	40.694	-21.244	-1.113	1,03		0,68
TDA TARRAGONA 1, FTA	49,17	631	-632	0	0,99		1,06
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	178,89	1.092	-679	0	0,80		0,47
WIZINK MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	-85,94	21.368	-1.088	-827	18,58		0,64
Subtotal BONOS 2022	-13,31	3.161.521	-1.479.519	-90.202	2,36		1,53
Subtotal BONOS 2021	8,98	3.226.078	-1.083.049	-161.761	2,13		0,68
%Variación	-	-2,00	36,61	-44,24	10,57		124,38

Miles de euros

FONDO	% VARIACIÓN MI (1)	INT ACTIVOS TITULIZADOS	INT OBLIGACIONES	OTROS INTERESES	TIPO INT DCHOS CREDITO (2)	TIPO INTERÉS OBLIGACIONES (3)
PAGARÉS						
Subtotal PAGARÉS 2022	0,00	0	0	0	0,00	0,00
Subtotal PAGARÉS 2021	0,00	0	0	0	0,00	0,00
%Variación	-	-	-	-	-	-
PRIVADOS						
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	467,46	1.933	-285	0	24,52	5,53
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	0,00	870	-596	-64	2,37	0,00
ASF 1, FONDO DE TITULIZACION	-	7	-8	0	15,04	4,40
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	-	1.548	-1.548	0	4,73	4,73
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACION	0,00	3	0	-7	0,00	0,00
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	9.504	-4.076	-5.851	1,49	0,23
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACION	-	1.525	-629	0	0,00	0,00
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACION	-	449	-328	0	5,19	0,00
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACION	-	173	-21	-4	9,93	4,53
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	850,19	1.716	-862	0	3,00	1,47
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	90,51	42	-26	-18	6,45	5,50
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACION	-31,39	8.709	-834	0	0,00	2,00
FACTOR ONE, FONDO DE TITULIZACION	-	4	-131	16	0,01	0,00
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	-	0	-6.997	12.961	0,00	12,75
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	-59,69	0	-1.536	1.640	0,00	12,48
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	0,00	0	-4.564	3.890	0,00	10,65
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	-40,54	0	-7.449	8.282	0,00	7,21
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	-50,51	0	-6.233	6.764	0,00	6,92
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	0,00	0	-14.515	16.090	0,00	10,70
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	-	120	-120	0	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	-	881	0	0	1,59	0,00
FTA2015, FTA	-35,22	56.581	-281.378	-99	1,09	0,00
HT NEXUS, FONDO DE TITULIZACION	326,79	1.957	0	-87	0,00	1,81
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	-19,49	680	-171	-34	0,00	2,78
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	142,27	2.376	-132	-562	5,55	0,00
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	-	2.512	-572	0	4,13	2,00
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	-	1.238	-623	-5	0,00	0,00
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	191,62	2.578	-1.292	0	0,00	0,00
IM GEDESCLUB, FONDO DE TITULIZACION	-	10	-12	-3	0,00	0,00
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	30,14	3.663	-2.577	0	0,00	3,71
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	92,78	9.104	-7.785	0	2,59	0,00
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	9,38	653	-534	0	2,72	0,00
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	83,92	450	-124	-12	0,01	0,00
IM VALL COMPANYS 1, FONDO DE TITULIZACION	0,27	264	-82	0	0,00	0,00
MONDEGO 2021, FONDO DE TITULIZACION	2,73	8.228	-5.536	7	1,12	0,00
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	0,00	950	-965	0	4,09	0,00
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	-	29	-16	0	0,00	7,50
PENSIUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	-	4	-3	0	5,90	3,00
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	-	406	-126	-7	7,00	4,69
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	280,13	9.776	-3.246	-1	0,00	0,00
SLF, FONDO DE TITULIZACION	37,06	16.625	-10.077	-48	2,79	0,00
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	0,00	15.966	-7.582	-4	4,44	0,00
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	-	17.706	-17.705	-1	4,93	0,00
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	493,22	13.136	-1.960	-246	3,26	0,00
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	85,73	1.844	-28	0	0,03	0,00
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0	0	-8	0,00	0,00
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	-2.245,45	0	0	-1	0,00	0,00
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	-	867	0	2	0,00	0,00
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	-	11.830	-2.009	-32	0,00	0,25
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	-	218	-189	8	9,52	0,00
UFASA CONSUMER FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	60,05	10.450	-1.831	-36	11,30	0,42
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	27,84	53.940	0	0	1,58	0,00
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	-26,03	1.966	-1.305	0	10,74	4,40
Subtotal PRIVADOS 2022	-1,00	273.489	-398.618	42.532	2,04	0,21
Subtotal PRIVADOS 2021	-57,04	333.880	-450.875	34.519	1,27	0,36
%Variación	98,25	-18,09	-11,59	23,21	60,87	-41,74
Total 2022	-13,98	3.435.010	-1.878.137	-47.671	2,34	1,48
Total 2021	16,92	3.559.958	-1.533.924	-127.242	2,10	0,67
%Variación	-	-3,51	22,44	-62,54	11,61	120,53

(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 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)	
BONOS					
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	-70	0	0	0	-494
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	-109	-11.171	0	0	-826
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-107	-36.222	0	0	-645
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	-154	-8.845	0	0	-533
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	-98	-36.993	0	0	-1.912
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	-100	-62.198	3.883	0	-1.473
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	-27	-7.243	6.502	0	-241
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	-22	0	6	-29	-81
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	-25	0	634	-760	-17
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	0	0	2	-2	0
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	0	0	1.538	-12	0
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	-180	0	3.835	-5.867	-156
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	-40	0	983	-1.031	-40
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	-41	0	225	-280	-28
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	-41	0	1.130	-1.180	-36
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	-58	0	1.638	-1.891	-51
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	-47	0	2.101	-2.901	-42
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	-57	0	447	-1.457	-33
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	-43	0	0	0	-40
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	-262	-11.563	1.462	0	-166
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	-93	0	0	0	-56
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	-102	0	0	0	-59
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	-43	-2.062	92	-32	-17
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	-55	-2.258	458	0	-22
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	-38	0	2.391	-2.509	0
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	-40	0	0	-94	-20
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	-21	0	334	-353	-5
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	-40	-758	352	0	-25
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	-65	0	1.007	-1.014	-42
BANCAJA 10, FTA	-132	0	25.028	-26.904	-71
BANCAJA 11, FTA	-102	0	11.510	-13.070	-64
BANCAJA 13, FTA	-165	0	24.378	-26.694	-126
BANCAJA 8, FTA	-81	0	15.434	-4.556	-22
BANCAJA 9, FTA	-96	0	18.207	-19.312	-36
BANKINTER 10, FTA	-45	0	3.583	-2.447	-31
BANKINTER 11, FTH	-40	0	2.324	-2.246	-23
BANKINTER 13 FTA	-59	0	6.517	-3.145	-41
BANKINTER 9, FTA	-40	0	2.032	-506	-21
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	-93	-13.441	3.915	0	-77
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-164	-42.213	14.140	0	-144
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACIÓN	-106	-21.089	11.407	0	-93
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	-182	-43.982	5.932	0	-165
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	-230	-75.873	12.486	0	-211
BBVA CONSUMO 9, FONDO DE TITULIZACION	-45	-18.222	6.576	0	-79
BBVA LEASING 1, FTA	-40	0	0	0	-20
BBVA LEASING 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	-166	-4.248	1.000	0	-144
BBVA RMBS 1, FTA	-102	0	15.150	-14.634	-77
BBVA RMBS 14, FTA	-52	-2.628	832	-110	-82
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	-160	-15.073	4.167	0	-164
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	-228	-6.052	2.043	0	-207
BBVA RMBS 2, FTA	-190	0	39.799	-10.130	-135
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	-248	-22.610	3.678	0	-277
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	-287	-60.470	13.169	0	-980
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	-24	-762	761	0	-20
BBVA RMBS 3, FTA	-184	0	20.314	-20.314	-120
BBVA RMBS 5 FTA	-241	0	7.025	-9.430	-230
BBVA RMBS 9, FTA	-93	-2.309	5.395	0	-112
BBVA-6 FTPYME FTA	-39	0	0	0	-13
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	-59	-2.116	0	0	-9
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	-44	-218	0	0	-9
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	-46	-1.135	0	0	-9
CAIXABANK CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	-111	-1.856	0	-3	-35
CAIXABANK CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	-110	-17.405	332	0	-51
CAIXABANK CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	-107	-14.979	1.148	0	-36
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	-422	-64.197	10.789	0	-152
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	-174	-3.249	595	0	-72
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	-266	-9.232	1.210	0	-117
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	-305	-3.192	1.891	0	-132

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)	
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	-416	-3.002	879	0	-173
CAIXABANK PYMES 8, FONDO DE TITULIZACION	-115	-1.013	103	0	-61
CAIXABANK PYMES 9, FONDO DE TITULIZACION	-109	-2.503	0	-8	-53
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	-894	-43.903	0	-238	-889
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	-413	-17.621	0	-36	-199
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	-379	-15.242	0	-30	-183
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	-59	0	0	0	-15
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	-38	-13.616	10.940	0	-1.716
CEDULAS TDA 6, FTA	0	0	0	0	0
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	-103	-92.829	4.145	0	-85
DRIVER ESPAÑA SIX, FONDO DE TITULIZACION	-78	-10.454	0	0	-3.399
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	-20	0	164	-224	-13
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	-60	0	1.093	-2.276	-54
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	-50	0	158	-1.044	-45
FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2014-1	-70	-2.654	0	0	0
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	-70	0	17.631	-17.984	-24
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	-90	0	10.439	-10.798	-24
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	-163	0	0	-359	-24
FTA UCI 11	-64	-3.342	4.339	0	-24
FTA UCI 14	-51	-19.806	16.038	0	-24
FTA UCI 16	-93	-29.702	26.415	0	-24
FTA, UCI 15	-70	-22.476	13.971	0	-24
FTA, UCI 17	-82	-21.687	18.151	0	-24
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	-78	0	0	0	-393
FTH UCI 12	-43	-7.830	4.874	0	-24
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	-617	-30.670	0	-5	-47
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	-79	-6.947	0	-1	-36
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	-80	-5.946	0	-1	-36
FONDO DE TITULIZACIÓN RMBS PRADO X	-65	-7.097	0	-1	-29
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-1	-72	-6.283	810	0	0
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2	-89	-18.855	5.996	0	-57
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	-145	-24.084	0	0	-730
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	-79	-7.317	0	-1	-36
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO V	-58	-3.014	0	0	-33
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO VI	-62	-2.812	0	-1	-36
FTPYME TDA CAM 4, FTA	-16	0	0	0	-9
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	-36	0	430	-429	-10
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	-24	0	0	-187	-9
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	-32	0	2.521	-4.649	-137
HIPOCAT 10, FTA	-66	0	6.631	-6.632	-10
HIPOCAT 11, FTA	-87	0	8.613	-8.613	-10
HIPOCAT 8, FTA	-64	-1.470	5.008	0	-10
HIPOCAT 9, FTA	-56	0	3.144	-3.144	-10
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	-95	-427	32	-59	-72
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	-148	-578	142	-169	-75
IM ANDBANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	-80	0	133	-133	-34
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	-69	-3.879	23.517	0	-55
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	-78	-8.216	16.112	0	-101
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	-83	-11.915	22.869	0	-117
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	-71	-9.986	9.986	0	-105
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	-64	-3.441	13.448	0	-59
IM BCG RMBS 2, FTA	-96	-478	40.437	-414	-92
IM CAJA LABORAL 1, FTA	-40	-359	2.610	0	-15
IM CAJA LABORAL 2, FTA	-58	-711	8.295	0	-21
IM CAJAMAR 3, FTA	-63	-1.199	14.272	0	-18
IM CAJAMAR 4, FTA	-65	-759	5.819	0	-18
IM CAJAMAR 5, FTA	-54	-55	6.297	-290	-22
IM CAJAMAR 6, FTA	-76	0	13.768	-1.018	-35

Miles de euros

FONDO	COMISIÓN GESTORA DEVENGADA EN EL PERIODO	COMISIÓN VARIABLE			
		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 CAJASTUR MBS 1, FTA	-78	-56	5.707	-214	-40
IM PASTOR 2, FTH	-11	0	3.538	-224	-9
IM PASTOR 3, FTH	-27	0	27.537	-27.537	-22
IM PASTOR 4, FTA	-34	0	10.364	-10.364	-27
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	-88	0	0	0	-50
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	-72	0	0	0	-46
MADRID RMBS I, FTA	-121	0	0	0	-28
MADRID RMBS II, FTA	-110	0	0	0	-19
MADRID RMBS III, FTA	-129	0	0	0	-41
MADRID RMBS IV, FTA	-126	0	0	0	-116
MBS BANCAJA 3, FTA	-44	0	8.645	-686	-12
MBS BANCAJA 4, FTA	-66	0	31.733	-2.011	-33
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	-63	-37.652	0	0	-98
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	-78	-58.164	0	0	-15.015
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	0	0	0	0	0
PYMES BANESTO 2, FTA	-2	0	6.751	-7.008	0
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	-1.036	-12.451	23.332	0	-49
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	-1.292	-1.540	1.540	0	-33
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA	-44	-88	3.640	0	-17
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	-50	-1.239	8.626	-29	-33
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	-43	-427	4.714	0	-23
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	-64	-1.124	1.152	-123	-46
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	-77	-1.555	1.410	0	-57
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	-45	-432	782	-31	-33
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	-17	-105	528	-171	-14
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	-97	-2.464	792	0	-41
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	-37	-464	1.016	-271	-29
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	-13	-105	353	-58	-12
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	-13	0	142	-169	-10
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	-64	-913	630	-39	-24
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	-77	0	0	0	-39
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	-66	-7.892	7.892	0	-106
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	-117	-29.266	2.565	0	-640
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-100	-16.289	1.216	0	-400
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE	-23	0	0	0	-111
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	-341	-55.886	9.118	0	-48
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	-81	-64.182	0	0	-310
TDA 19 - MIXTO, FTA	-72	-18	0	0	0
TDA 22 - MIXTO, FTA	-120	0	0	0	0
TDA 24, FTA	-132	0	0	0	-14
TDA 25, FTA	-53	0	0	0	-13
TDA 26 - MIXTO, FTA	-60	-273	0	0	-27
TDA 27, FTA	-62	0	0	0	-18
TDA 28, FTA	-36	0	0	0	-70
TDA 29, FTA	-58	-376	0	0	-18
TDA 30, FTA	-31	-554	0	0	-16
TDA CAJAMAR 2, FTA	-46	-1.171	0	0	-16
TDA CAM 4, FTA	-47	-1.177	0	0	-9
TDA CAM 5, FTA	-75	-1.064	0	0	-9
TDA CAM 6, FTA	-59	0	0	0	-9
TDA CAM 7, FTA	-70	-115	0	0	-9
TDA CAM 8, FTA	-64	0	0	0	-9
TDA CAM 9, FTA	-71	0	0	0	-9
TDA IBERCAJA 2, FTA	-41	0	0	0	-31
TDA IBERCAJA 3, FTA	-39	-1.001	0	0	-27
TDA IBERCAJA 4, FTA	-63	-3.503	0	0	-32
TDA IBERCAJA 5, FTA	-61	-2.541	0	0	-34
TDA IBERCAJA 6, FTA	-62	0	0	0	-41
TDA IBERCAJA 7, FTA	-117	-3.003	0	0	-13
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	-49	0	0	0	-26
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	-170	0	0	0	-416
TDA TARRAGONA 1, FTA	-39	-254	0	0	-10
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	-40	-974	5.939	0	-19
WIZINK MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	-91	-88.275	0	-50.388	-1.913
Subtotal BONOS 2022	-20.304	-1.486.636	831.683	-330.980	-41.487
Subtotal BONOS 2021	-20.178	-1.509.565	896.901	-323.200	-46.384
%Variación	0,63	-1,52	-7,27	2,41	-10,56

Miles de euros

FONDO	COMISIÓN GESTORA DEVENGADA EN EL PERIODO	COMISIÓN VARIABLE			
		IMPORTE DEVENGADO EN EL PERIODO	IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR (1)	CORRECCIONES DE VALOR POR REPERCUSIÓN DE PÉRDIDAS (1)	OTRAS COMISIONES DEVENGADAS EN EL PERIODO
PAGARES					
Subtotal PAGARÉS 2022	0	0	0	0	0
Subtotal PAGARÉS 2021	0	0	0	0	0
%Variación	-	-	-	-	-
PRIVADOS					
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	-68	-1.286	0	-1	-5
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	-70	0	0	0	-42
ASF 1, FONDO DE TITULIZACION	-67	0	0	0	-66
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	0	0	0	0	0
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACIÓN	-78	0	0	0	-53
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	-202	728	2.896	0	-76
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	0	0
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACIÓN	-65	0	0	0	-64
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	-80	0	0	0	-4
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	-214	-193	15	0	-537
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	-29	0	0	-3	-2
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACIÓN	-40	-5.792	0	0	-17
FACTOR ONE, FONDO DE TITULIZACION	-47	0	0	0	-34
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	-310	-5.967	5.967	0	-2
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	-100	0	192	-118	-9
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	-219	0	149	-149	-9
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	-344	-604	604	0	-17
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	-411	-383	383	0	-16
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	-700	-1.262	1.262	0	-8
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	-3	0	20	-4	0
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	-5	0	0	0	-1
FTA2015, FTA	-360	0	0	0	-10.302
HT NEXUS, FONDO DE TITULIZACION	-55	-1.793	236	0	-16
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	-59	-315	547	0	-25
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	-170	-1.002	125	0	-39
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	-125	-1.101	1.101	0	-15
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	-148	0	0	0	-457
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	-87	-673	469	0	-421
IM GEDESCLUB, FONDO DE TITULIZACION	-130	0	0	0	-4
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	-127	-207	0	0	-603
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	-185	0	0	0	-858
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	-51	0	0	0	-61
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	-60	-154	4	0	-59
IM VALL COMPANYS 1, FONDO DE TITULIZACIÓN	-82	0	130	-113	-34
MONDEGO 2021, FONDO DE TITULIZACION	-72	0	0	0	-1.147
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	-13	0	0	0	-18
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACIÓN	-79	0	0	0	-13
PENSUM ESG I, FONDO DE TITULIZACIÓN	-74	0	0	0	-7
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	-36	0	0	0	-66
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	-58	-6.430	0	0	-12
SLF, FONDO DE TITULIZACION	-31	0	0	0	-1.704
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	-36	0	0	0	-418
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	-78	0	0	0	0
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	-62	-11.121	0	0	-200
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	-115	0	0	0	-131
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	-78	0	0	0	-78
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	-33	0	0	0	-20
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	-33	0	0	0	-2
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	-83	0	0	0	-3.059
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	-16	-47	47	0	-5
UFASA CONSUMER FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	-125	-5.975	1.092	0	-100
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	-66	0	0	0	-11.094
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	-102	0	0	-6	-147
Subtotal PRIVADOS 2022	-5.878	-43.576	15.240	-394	-32.074
Subtotal PRIVADOS 2021	-3.717	-21.539	4.742	-453	-29.195
%Variación	58,15	102,31	221,38	-13,10	9,86
Total 2022					
Total 2022	-26.183	-1.530.212	846.922	-331.373	-73.561
Total 2021	-23.895	-1.531.104	901.643	-323.653	-75.579
%Variación	9,57	-0,06	-6,07	2,39	-2,67

(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	23.273	-22.782	0	0	177.672	-183.378	-564	-0,22
AUTO ABS SPANISH LOANS 2018-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	13.231	-1.335	0	-224	121.261	-127.163	-12.110	-10,89
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	40.260	-3.653	183	0	241.397	-244.521	-36.976	-9,88
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	-825.809	705.900	26.438	-6.407	0	-2.905	140.751	-982	-9.430	-1,29
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	0	0	39.769	-4.784	1.767	-580	243.678	-250.884	-41.733	-9,91
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	-174.402	0	68.876	-7.835	3.726	-973	341.854	-171.007	-61.826	-6,88
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	-622.516	600.000	11.006	-4.183	0	-1.468	33.507	0	-1.608	-0,25
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	0	0	306	-550	0	0	26.585	-25.502	-99	-0,05
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	0	0	938	-141	331	-818	8.771	-8.684	-34	-0,06
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	0	0	194.090	-194.673	0	0	1.400.000	-1.400.000	-217	-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	6.537	-14.195	124	-442	157.727	-145.311	-354	-0,03
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	0	0	286	-151	64	-124	31.848	-31.472	-61	-0,03
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FTH	0	0	255	-57	41	-100	16.583	-16.640	-61	-0,08
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	0	0	696	-563	396	-296	35.181	-35.052	-62	-0,03
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	0	0	615	-455	239	-343	53.230	-53.639	-80	-0,03
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	0	0	752	-752	584	-567	37.167	-34.819	-65	-0,03
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	0	0	336	-477	44	-52	44.475	-41.028	-62	-0,02
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	0	0	505	-679	149	-175	34.475	-30.852	-82	-0,04
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	0	0	6.220	-4.292	-1.387	1.632	204.029	-189.690	-12.078	-0,89
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	0	0	2.599	-222	-1.455	1.004	68.418	-61.874	-150	-0,03
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	0	0	1.266	-273	-1.239	1.032	77.660	-67.147	-165	-0,03
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	0	0	1.748	-111	483	-1.056	28.920	-27.493	-2.235	-1,22
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	0	0	1.564	-89	618	-1.017	34.942	-33.180	-2.072	-0,98
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	0	0	0	-38	0	0	0	0	-38	-14,14
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	0	0	918	-289	433	-727	18.707	-18.214	-50	-0,05
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	0	0	224	-99	185	-121	6.610	-6.144	-42	-0,08
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	0	0	915	-125	212	-456	23.833	-23.309	-539	-0,35
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	0	0	3.375	-112	-75	-2.885	48.662	-41.557	-1.829	-0,59
BANCAJA 10, FTA	0	0	3.663	-649	2.695	-2.298	84.126	-76.061	-139	-0,02
BANCAJA 11, FTA	0	0	2.934	-465	2.557	-2.135	57.298	-57.135	-108	-0,02
BANCAJA 13, FTA	0	0	5.781	-2.644	5.559	-3.521	121.082	-95.118	-171	-0,01
BANCAJA 8, FTA	0	0	1.432	-1.218	765	-733	33.744	-31.252	-83	-0,04
BANCAJA 9, FTA	0	0	1.918	-1.493	1.695	-1.217	46.355	-43.300	-100	-0,03
BANKINTER 10, FTA	0	0	734	-1.266	909	-862	42.801	-41.117	-53	-0,02
BANKINTER 11, FTH	0	0	336	-509	312	-530	23.536	-23.303	-49	-0,03
BANKINTER 13 FTA	0	0	813	-408	586	-1.298	53.135	-46.711	-70	-0,02
BANKINTER 9, FTA	0	0	430	-70	319	-496	22.835	-22.574	-49	-0,04
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	0	0	18.880	-2.623	0	0	138.406	-156.901	-16.759	-7,39
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-80.715	0	63.402	-10.148	105	-1.331	319.952	-260.974	-47.579	-5,25

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)
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACIÓN	-1.199.989	1.205.500	35.785	-6.411	3.744	-11.063	162.001	-114.335	-9.834	-0,85
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	0	0	74.887	-7.842	0	0	438.551	-473.754	-42.742	-4,77
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	0	0	108.241	-1.069	0	0	601.876	-639.516	-79.091	-5,55
BBVA CONSUMO 9, FONDO DE TITULIZACION	0	0	18.963	-2.392	0	0	141.793	-144.340	-12.989	-4,86
BBVA LEASING 1, FTA	0	0	187	-213	57	-203	3.633	-3.504	-59	-1,49
BBVA LEASING 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	17.975	-5.028	0	0	449.339	-479.930	-5.250	-0,62
BBVA RMBS 1, FTA	0	0	3.579	-2.245	6.579	-3.576	98.347	-95.886	-180	-0,03
BBVA RMBS 14, FTA	0	0	4.173	-1.335	0	0	43.520	-44.165	-3.178	-0,91
BBVA RMBS 17 FONDO DE TITULIZACION	0	0	18.457	-1.438	0	0	172.875	-158.048	-15.601	-1,35
BBVA RMBS 19, FONDO DE TITULIZACION	0	0	28.850	-3.550	10.272	-28.285	204.040	-196.258	-5.529	-0,34
BBVA RMBS 2, FTA	0	0	6.524	-3.853	12.022	-6.507	176.966	-172.923	-328	-0,03
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	0	0	32.957	-2.689	26.078	-32.473	245.789	-239.932	-23.450	-0,90
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	-12.400.000	12.400.000	79.604	-14.777	66.488	-62.221	1.054.149	-847.345	-48.329	-0,38
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	-1.399.982	1.400.000	180	0	0	0	15.230	0	0	0,00
BBVA RMBS 3, FTA	0	0	7.053	-1.423	9.256	-5.942	108.149	-112.412	-306	-0,03
BBVA RMBS 5 FTA	0	0	10.653	-7.555	0	0	173.127	-170.610	-290	-0,02
BBVA RMBS 9, FTA	0	0	4.147	-1.816	0	0	67.748	-67.033	-2.563	-0,38
BBVA-6 FTPYME FTA	0	0	60	-84	37	-60	1.776	-1.488	-52	-0,64
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	0	0	2.108	-126	0	-698	23.782	-23.617	-2.184	-1,62
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	0	0	700	-514	47	0	6.622	-6.937	-271	-0,32
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	0	0	446	-159	55	0	5.709	-5.428	-1.190	-3,63
CAIXABANK CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	3.545	-1.648	0	0	33.446	-35.895	-2.682	-1,40
CAIXABANK CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	11.568	-2.629	0	0	131.054	-131.405	-18.511	-6,67
CAIXABANK CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	14.803	-4.810	0	0	142.631	-160.099	-16.472	-11,66
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	0	0	114.321	-13.722	0	0	768.743	-914.665	-69.477	-5,62
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	11.227	-5.067	0	0	256.118	-263.846	-3.768	-0,84
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	0	0	21.219	-8.419	0	0	358.667	-392.063	-11.889	-1,27
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	0	0	22.290	-9.945	0	0	364.180	-397.784	-1.767	-0,16
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	0	0	25.694	-5.792	0	0	523.316	-540.271	-3.736	-0,26
CAIXABANK PYMES 8, FONDO DE TITULIZACION	0	0	8.318	-4.697	0	0	121.249	-129.666	-1.092	-0,24
CAIXABANK PYMES 9, FONDO DE TITULIZACION	0	0	8.188	-3.819	0	0	170.914	-182.464	-3.575	-1,26
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	74.460	-38.040	0	0	1.010.320	-968.751	-49.463	-0,56
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	0	0	26.736	-2.898	0	0	192.246	-189.843	-22.786	-1,23
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	24.827	-8.024	0	0	207.373	-203.966	-16.795	-1,05
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	0	0	145	-226	0	0	12.081	-11.412	-74	-0,07
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	-1.295.715	1.227.700	17.404	-5.989	0	0	105.970	0	-4.261	-0,34
CEDULAS TDA 6, FTA	0	0	116.250	-116.250	0	0	0	0	0	0,00
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	-418.306	0	112.540	-1.400	0	0	396.972	0	-97.987	-14,87
DRIVER ESPAÑA SIX, FONDO DE TITULIZACION	0	0	4.690	-1.456	610	0	250.045	-218.911	-13.999	-6,06
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	0	0	51	-35	50	-53	653	-361	-32	-0,36
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	0	0	1.912	-879	0	-994	23.639	-22.040	-70	-0,05
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	0	0	1.298	-1.887	0	-398	17.577	-17.059	-60	-0,06

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)
FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2014-1	0	0	9.714	-7.573	0	0	76.867	-79.481	-3.256	-2,78
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	0	0	29	-327	328	-71	3.670	-3.813	-70	-0,98
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	0	0	1.410	-534	2.067	-1.138	49.955	-47.377	-93	-0,03
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	0	0	3.092	-276	4.066	-2.693	76.531	-75.653	-166	-0,03
FTA UCI 11	0	0	1.652	-376	0	0	20.354	-14.695	-6.745	-5,99
FTA UCI 14	0	0	5.168	-885	0	0	75.946	-43.049	-35.703	-13,26
FTA UCI 16	0	0	10.032	-1.862	0	0	130.549	-61.015	-75.991	-16,72
FTA, UCI 15	0	0	6.311	-1.145	0	0	82.899	-47.338	-40.123	-11,91
FTA, UCI 17	0	0	7.624	-3.126	1.871	-2.197	104.629	-57.817	-47.278	-11,92
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	0	0	208.010	-149.297	0	0	1.814.697	-1.408.400	-1.973	-0,02
FTH UCI 12	0	0	2.701	-473	0	0	35.983	-24.237	-13.686	-8,92
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	-432.273	0	42.679	-2.623	0	0	1.214.132	-999.043	-31.388	-1,62
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	0	0	9.725	-2.694	613	-324	53.487	-53.887	-7.062	-1,51
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	0	0	9.155	-2.396	0	0	46.605	-46.436	-6.065	-1,45
FONDO DE TITULIZACIÓN RMBS PRADO X	-565.000	567.754	7.833	-3.108	0	163	42.652	-40.524	-7.184	-1,27
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-1	0	0	14.032	-7.187	0	0	105.744	-120.135	-8.208	-5,52
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2016-2	0	0	29.394	-7.856	0	0	166.296	-175.463	-21.642	-7,00
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	-166.691	0	34.466	-4.002	855	0	163.994	-2.320	-24.959	-3,99
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	0	0	9.950	-3.049	1.557	-779	43.302	-42.508	-7.434	-1,55
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO V	0	0	4.531	-953	0	0	31.509	-31.258	-3.105	-1,12
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO VI	0	0	5.691	-1.309	0	-1.228	35.909	-35.037	-2.910	-0,94
FTPME TDA CAM 4, FTA	0	0	368	-254	168	0	11.501	-10.157	-25	-0,03
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	0	0	451	-306	280	-463	12.315	-12.485	-46	-0,13
GC FTPME PASTOR 4, FTA	0	0	120	-75	107	-122	1.945	-2.187	-33	-0,52
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	0	0	1.140	-375	903	-1.285	20.346	-19.818	-41	-0,03
HIPOCAT 10, FTA	0	0	1.716	-57	1.426	-1.603	29.563	-31.522	-78	-0,04
HIPOCAT 11, FTA	0	0	2.090	-28	1.396	-1.995	29.653	-32.296	-100	-0,05
HIPOCAT 8, FTA	0	0	1.869	-464	1.469	-1.796	26.694	-25.142	-2.175	-1,27
HIPOCAT 9, FTA	0	0	1.032	-10.006	876	-960	18.829	-17.111	-68	-0,05
HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION	0	0	2.111	-424	0	0	63.445	-54.327	-706	-0,11
HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION	0	0	2.898	-577	0	0	72.149	-66.194	-859	-0,13
IM ANDBANK RMBS 1,FONDO DE TITULIZACION	-197.354	174.500	1.008	-530	0	0	37.518	0	-168	-0,10
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	5.503	-1.337	0	0	46.790	-45.962	-3.838	-0,91
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	0	0	8.469	-191	0	0	62.096	-61.126	-7.857	-1,38
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	17.782	-4.118	0	0	216.226	-222.642	-275	-0,04
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	-900.000	900.000	13.022	-3.104	0	0	202.507	-186.044	-804	-0,11
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	6.893	-3.252	0	0	107.434	-114.288	-3.544	-1,30
IM BCG RMBS 2, FTA	0	0	3.196	-1.993	0	0	79.567	-76.500	-247	-0,03
IM CAJA LABORAL 1, FTA	0	0	649	-354	0	62	25.857	-24.631	-362	-0,30
IM CAJA LABORAL 2, FTA	0	0	1.242	-470	0	2.738	27.361	-25.184	-120	-0,04
IM CAJAMAR 3, FTA	0	0	1.027	-568	0	-137	31.454	-27.320	-3.217	-1,80
IM CAJAMAR 4, FTA	0	0	1.168	-835	0	357	30.917	-28.801	-1.774	-0,95

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)
IM CAJAMAR 5, FTA	0	0	1.177	-950	0	0	30.610	-26.761	-2.022	-1,07
IM CAJAMAR 6, FTA	0	0	2.364	-2.815	0	0	66.875	-57.926	-4.306	-0,91
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	0	0	930	-884	399	0	28.791	-28.373	-576	-0,21
IM PASTOR 2, FTH	0	0	323	-401	102	-2	12.470	-12.554	-258	-0,50
IM PASTOR 3, FTH	0	0	953	-423	0	-467	15.824	-15.914	-99	-0,09
IM PASTOR 4, FTA	0	0	1.091	-1.493	0	-323	18.190	-17.053	-115	-0,08
MADRID RESIDENCIAL I, FTA	0	0	2.468	-310	473	0	37.825	-14.821	-138	-0,04
MADRID RESIDENCIAL II, FTA	0	0	2.119	-314	680	0	30.621	-15.077	-133	-0,04
MADRID RMBS I, FTA	0	0	4.503	-1.047	0	-17	58.995	-53.059	-143	-0,03
MADRID RMBS II, FTA	0	0	3.873	-974	0	-306	51.541	-48.862	-130	-0,03
MADRID RMBS III FTA	0	0	7.143	-942	510	0	90.451	-82.966	-168	-0,02
MADRID RMBS IV, FTA	0	0	4.687	-2.210	375	0	69.757	-63.286	-254	-0,03
MBS BANCAJA 3, FTA	0	0	683	-693	508	-394	17.547	-16.899	-678	-0,69
MBS BANCAJA 4, FTA	0	0	1.701	-2.615	1.177	-1.094	43.850	-42.044	-69	-0,02
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	-421.486	0	54.084	-1.393	0	0	403.303	0	-37.812	-4,37
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	-631.399	0	48.501	-720	0	0	663.038	0	-73.257	-4,84
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	0	0	217.388	-217.388	0	0	0	0	0	0,00
PYMES BANESTO 2, FTA	0	0	21	-37	12	-26	2.893	-2.725	-2	-0,02
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	0	0	33.348	-4.736	0	0	410.920	-385.442	-1.073	-0,03
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	0	0	29.518	-4.053	0	0	444.304	-436.111	-1.314	-0,03
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA	0	0	897	-325	169	-420	21.396	-21.164	-642	-0,59
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	0	0	2.370	-715	812	-1.034	42.342	-39.216	-4.897	-1,75
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	0	0	1.383	-349	231	-651	27.507	-27.683	-956	-0,59
RURAL HIPOTECARIO X, FTA	0	0	3.069	-819	1.211	-1.546	53.575	-53.499	-1.607	-0,40
RURAL HIPOTECARIO XI, FTA	0	0	3.881	-2.020	2.099	-1.996	68.633	-68.335	-1.547	-0,29
RURAL HIPOTECARIO XII, FTA	0	0	1.985	-1.080	1.250	-1.170	35.280	-35.293	-418	-0,15
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	0	0	525	-146	0	0	10.025	-9.365	-246	-0,27
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	0	0	4.448	-766	0	0	38.737	-35.446	-2.674	-0,77
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	0	0	1.588	-397	0	0	30.573	-30.593	-64	-0,03
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	0	0	432	-49	0	0	9.413	-8.018	-313	-0,49
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	0	0	387	-297	0	0	4.406	-4.419	-19	-0,04
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	0	0	2.041	-646	0	0	23.537	-22.229	-1.139	-0,62
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	18.879	-3.355	95	0	151.082	-169.386	-118	-0,05
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	-750.000	759.100	19.796	-10.974	1.586	-5.694	99.875	-99.774	-153	-0,02
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	0	0	35.462	-2.978	1.851	-630	180.230	-192.857	-31.695	-8,21
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	20.912	-2.811	49	0	108.946	-114.831	-15.619	-5,88
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE	-677.015	706.859	3.315	-1.901	-111	-29.830	19.244	0	-96	-0,01
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	-168.061	0	85.291	-12.362	853	0	611.161	-496.221	-47.161	-4,29
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	-2.145.342	0	177.542	-82.100	0	-16.903	2.174.719	0	-64.501	-0,39
TDA 19 - MIXTO, FTA	0	0	806	-360	0	-473	8.773	-8.470	-90	-0,18
TDA 22 - MIXTO, FTA	0	0	698	-497	0	-527	8.411	-7.379	-120	-0,20
TDA 24, FTA	0	0	2.333	-160	0	-1.015	9.509	-8.167	-145	-0,22

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 25, FTA	0	0	504	-317	0	0	4.842	-3.732	-66	-0,09
TDA 26 - MIXTO, FTA	0	0	857	-416	0	-383	17.639	-16.699	-360	-0,35
TDA 27, FTA	0	0	3.131	-515	0	0	24.071	-26.037	-80	-0,04
TDA 28, FTA	0	0	1.276	-183	0	0	11.625	-10.530	-108	-0,07
TDA 29, FTA	0	0	1.142	-509	0	-116	23.208	-22.176	-451	-0,28
TDA 30, FTA	0	0	675	-636	354	0	13.301	-13.455	-601	-0,54
TDA CAJAMAR 2, FTA	0	0	3.150	-386	0	-2.180	19.765	-19.210	-1.232	-1,10
TDA CAM 4, FTA	0	0	1.044	-367	0	-99	32.987	-32.360	-1.233	-0,90
TDA CAM 5, FTA	0	0	2.075	-220	0	-468	46.921	-45.362	-1.148	-0,36
TDA CAM 6, FTA	0	0	1.499	-185	0	-446	29.994	-29.347	-68	-0,03
TDA CAM 7, FTA	0	0	2.202	-540	0	-92	47.521	-46.450	-193	-0,06
TDA CAM 8, FTA	0	0	2.061	-781	0	-206	46.531	-46.587	-73	-0,02
TDA CAM 9, FTA	0	0	2.000	-410	0	-108	41.654	-39.149	-79	-0,02
TDA IBERCAJA 2, FTA	0	0	741	-158	0	-92	22.761	-22.410	-72	-0,07
TDA IBERCAJA 3, FTA	0	0	1.088	-683	9	0	27.952	-26.487	-1.068	-0,71
TDA IBERCAJA 4, FTA	0	0	1.772	-716	0	-312	43.000	-40.087	-3.598	-1,52
TDA IBERCAJA 5, FTA	0	0	1.638	-675	0	-166	41.109	-37.579	-2.636	-1,07
TDA IBERCAJA 6, FTA	0	0	2.956	-1.208	0	-671	62.852	-59.004	-105	-0,03
TDA IBERCAJA 7, FTA	0	0	4.002	-2.787	496	0	97.280	-97.858	-3.135	-0,40
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FTH	0	0	904	-312	0	-520	18.169	-18.484	-75	-0,10
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	39.991	-12.608	0	-8.647	446.009	-443.676	-176	0,00
TDA TARRAGONA 1, FTA	0	0	557	-664	93	0	9.019	-8.551	-303	-0,41
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	0	0	1.017	-599	795	-447	26.233	-25.036	-1.751	-1,28
WIZINK MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	0	0	51.323	-1.105	0	0	1.231.613	-340.361	-119.107	-58,33
Subtotal BONOS 2022	-25.472.055	20.647.313	3.128.887	-1.294.819	190.281	-271.498	28.034.539	-21.638.015	-1.647.631	-1,08
Subtotal BONOS 2021	-23.568.770	17.939.599	3.404.985	-1.328.848	64.074	-213.736	29.882.907	-24.630.006	-1.755.204	-1,16
%Variación	8,08	15,09	-8,11	-2,56	196,97	27,02	-6,19	-12,15	-6,13	-6,50
PAGARES										
Subtotal PAGARÉS 2022	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00
Subtotal PAGARÉS 2021	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00
%Variación	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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)
PRIVADOS										
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	-26.628	6.600	1.652	-236	0	0	19.234	0	-1.416	-13,52
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	-62.711	88.021	794	-632	0	0	6.682	-25.000	-297	-0,29
ASF 1, FONDO DE TITULIZACION	-551	700	4	-6	0	0	337	0	-133	-27,88
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	0	0	1.867	-1.867	0	0	9.876	-9.876	-45	-0,15
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	0	0	0	31.822	-33.005	-131	-0,05
CAIXABANK CORPORATES 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	9.149	-4.967	0	0	460.614	-1.468.864	-399	-0,04
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	-622	622	0	0	0	0	0,00
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACIÓN	-19.000	19.000	448	-118	0	0	0	0	-72	-0,37
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	-2.428	3.100	146	-10	0	0	1.377	0	-92	-2,89
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	-318.731	318.734	1.726	-704	0	0	299.373	-299.366	-860	-2,86
EBN GESTERNOVA FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	-437	400	35	-20	0	0	34	0	-31	-3,93
ELECNR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	2.664	-834	0	0	11.121	-8.000	-5.849	-7,61
FACTOR ONE, FONDO DE TITULIZACION	-418	14.904	3	0	0	0	385	0	-143	-0,91
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	0	223.500	0	-5.090	0	0	0	0	-283	-0,09
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	0	0	0	-1.546	0	0	0	-5.720	-109	-0,83
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	0	0	0	-4.726	0	0	0	-23.745	-239	-0,54
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	0	0	0	-7.415	0	0	0	-53.623	-365	-0,31
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	0	0	0	-5.952	0	0	0	-56.029	-429	-0,43
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	0	0	0	-13.783	0	0	0	-50.807	-710	-0,47
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	0	0	118	-123	0	0	909	-841	0	0,00
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	-345.502	345.502	668	0	0	0	2.910	0	0	0,00
FTA2015, FTA	0	0	10.538	-280.950	0	0	287.202	0	-11.307	-2,36
HT NEXUS, FONDO DE TITULIZACION	-45.897	7.636	0	-58	0	0	47.914	-7.442	-1.718	-29,94
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	-47.772	31.336	0	-163	0	0	48.092	-31.537	-237	-1,75
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	-113.642	43.955	0	-685	0	0	106.625	-44.415	-1.086	-3,12
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	-21.961	22.600	358	-192	0	0	0	0	-348	-1,44
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	-120.188	121.010	82	-39	0	0	22.218	-22.261	-601	-0,61
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	-1.421.699	326.635	2.565	-263	0	0	1.482.859	-326.037	-812	-0,32
IM GEDESLUB, FONDO DE TITULIZACION	-369	500	10	-9	0	0	500	0	-107	-19,47
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	-17.010	8.086	3.663	-2.590	0	0	22.483	-12.654	-1.019	-1,94
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	-20.000	20.044	8.487	-7.515	0	0	47.500	-47.187	-972	-0,29
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	649	-554	0	0	0	0	-114	-0,48
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	-107.187	27.738	396	-90	0	0	102.773	-24.910	-261	-1,27
IM VALL COMPANYS 1, FONDO DE TITULIZACIÓN	-143.889	29.911	278	-33	0	0	155.268	-34.967	-224	-2,01
MONDEGO 2021, FONDO DE TITULIZACION	0	0	2.330	-5.536	0	0	15.565	-10.787	-1.226	-0,90
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	-93.000	310.480	420	-234	0	0	0	-217.480	-70	-0,07
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACIÓN	-5.594	6.205	29	0	0	0	5	0	-53	-0,87
PENSIUM ESG I, FONDO DE TITULIZACIÓN	-107	200	2	-3	0	0	6	0	-91	-81,55
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	-12.707	12.415	332	-120	0	-20	520	-2	-93	-0,74
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	-3.237	0	0	17.175	-8.200	-5.706	-2,82
SLF, FONDO DE TITULIZACION	0	0	2.127	-10.100	0	0	31.411	-20.904	-1.883	-1,90

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)
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	0	0	1.253	-12.121	0	0	34.465	-23.496	-512	-0,93
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	-398.047	398.047	0	0	0	0	0	0	-76	-0,02
SWK CONSUMER 2021-1, FONDO DE TITULIZACION	-187.537	0	13.118	-2.245	0	0	169.739	0	-11.414	-2,80
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	1.844	-28	0	0	35.131	-39.247	-246	-0,17
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	40.848	-41.659	-156	-0,08
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	5.382	-5.136	-52	-0,41
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	-105.331	106.000	867	0	0	0	1.158	0	0	0,00
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	-198.583	202.300	11.830	-2.009	0	0	14.292	-18.084	-3.141	-1,81
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	-23.500	45.405	0	-1	0	0	478	-205	-73	-0,16
UFASA CONSUMER FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	-98.686	55.367	10.083	-1.781	0	0	45.785	-4.117	-5.214	-4,19
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	0	0	16.799	0	0	0	110.203	-110.194	-12.294	-3,61
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	-15.098	3.000	2.331	-1.067	0	0	14.893	0	-251	-0,94
Subtotal PRIVADOS 2022	-3.974.211	2.799.332	109.666	-380.275	622	-20	3.705.165	-3.085.796	-72.960	-1,07
Subtotal PRIVADOS 2021	-4.488.477	3.833.040	170.998	-493.620	584	0	3.135.875	-944.400	-53.779	-0,77
%Variación	-11,46	-26,97	-35,87	-22,96	6,51	-	18,15	226,75	35,67	39,66
Total 2022	-29.446.265	23.446.645	3.238.553	-1.675.094	190.903	-271.518	31.739.704	-24.723.811	-1.720.591	-1,08
Total 2021	-28.057.247	21.772.639	3.575.983	-1.822.468	64.658	-213.736	33.018.782	-25.574.406	-1.808.983	-1,14
%Variación	4,95	7,69	-9,44	-8,09	195,25	27,03	-3,87	-3,33	-4,89	-5,12

(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.