



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

Ejercicio 2024

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
-

	31/12/2024					31/12/2023					
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
ACTIVO											
A) ACTIVO NO CORRIENTE	90.341.676	-	90.341.676	3.667.791	94.009.467	104.772.484	-	104.772.484	3.259.893	108.032.377	-12,98
I. Activos financieros a largo plazo	90.341.676	-	90.341.676	3.667.420	94.009.096	104.772.484	-	104.772.484	3.258.673	108.031.157	-12,98
1. Activos titulizados	89.176.130	-	89.176.130	3.246.341	92.422.471	103.134.904	-	103.134.904	2.684.128	105.819.032	-12,66
1.1 Participaciones hipotecarias	14.618.946	-	14.618.946	345.439	14.964.385	12.414.475	-	12.414.475	0	12.414.475	20,54
1.2 Certificados de transmisión de hipoteca	45.896.360	-	45.896.360	194.307	46.090.667	53.597.534	-	53.597.534	213.739	53.811.273	-14,35
1.3 Préstamos hipotecarios	65.035	-	65.035	0	65.035	81.120	-	81.120	0	81.120	-19,83
1.4 Cédulas hipotecarias	6.660.000	-	6.660.000	0	6.660.000	11.660.000	-	11.660.000	0	11.660.000	-42,88
1.5 Préstamos a promotores	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.6 Préstamos a PYMES	3.098.230	-	3.098.230	125.266	3.223.496	5.192.594	-	5.192.594	96.419	5.289.013	-39,05
1.7 Préstamos a empresas	9.829	-	9.829	465.086	474.915	13.590	-	13.590	471.101	484.691	-2,02
1.8 Préstamos corporativos	0	-	0	36.262	36.262	0	-	0	35.941	35.941	0,89
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	0	0	0	-	0	9.876	9.876	-100,00
1.13 Préstamos consumo	8.956.622	-	8.956.622	158.758	9.115.380	7.435.900	-	7.435.900	110.521	7.546.421	20,79
1.14 Préstamos automoción	5.307.656	-	5.307.656	0	5.307.656	5.202.842	-	5.202.842	0	5.202.842	2,01
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	944.387	-	944.387	0	944.387	1.805.073	-	1.805.073	0	1.805.073	-47,68
1.16 Cuentas a cobrar	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.17 Derechos de crédito futuros	0	-	0	720.812	720.812	0	-	0	652.356	652.356	10,49
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	2.774.214	-	2.774.214	717.891	3.492.105	4.697.705	-	4.697.705	561.028	5.258.733	-33,59
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0	-	0	4.519	4.519	0	-	0	3.747	3.747	20,60
1.22 Activos dudosos -principal-	1.192.443	-	1.192.443	621.997	1.814.440	1.317.307	-	1.317.307	686.444	2.003.751	-9,45
1.23 Activos dudosos -intereses-	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	-347.591	-	-347.591	-143.995	-491.586	-283.234	-	-283.234	-157.045	-440.279	11,65
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2. Derivados	1.123.535	-	1.123.535	2.638	1.126.173	1.592.262	-	1.592.262	3.641	1.595.903	-29,43
2.1 Derivados de cobertura	1.123.535	-	1.123.535	2.638	1.126.173	1.592.262	-	1.592.262	3.641	1.595.903	-29,43
2.2 Derivados de negociación	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
3. Otros activos financieros	42.011	-	42.011	418.441	460.452	45.319	-	45.319	570.904	616.223	-25,28
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	80	-	80	0	80	120	-	120	0	120	-33,33
3.4 Otros	41.931	-	41.931	418.441	460.372	45.199	-	45.199	570.904	616.103	-25,28
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	371	371	0	-	0	1.220	1.220	-69,59

	31/12/2024					31/12/2023					
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	35.414.409	-	35.414.409	3.830.186	39.244.595	26.777.959	-	26.777.959	2.789.087	29.567.046	32,73
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	283.197	-	283.197	0	283.197	322.832	-	322.832	0	322.832	-12,28
V. Activos financieros a corto plazo	27.235.328	-	27.235.328	2.122.615	29.357.943	18.492.717	-	18.492.717	1.875.166	20.367.883	44,14
1. Activos titulizados	25.855.167	-	25.855.167	1.733.390	27.588.557	16.894.716	-	16.894.716	1.496.083	18.390.799	50,01
1.1 Participaciones hipotecarias	1.486.045	-	1.486.045	34.600	1.520.645	1.546.636	-	1.546.636	12.720	1.559.356	-2,48
1.2 Certificados de transmisión de hipoteca	7.086.963	-	7.086.963	58.344	7.145.307	3.482.842	-	3.482.842	61.704	3.544.546	101,59
1.3 Préstamos hipotecarios	11.650	-	11.650	0	11.650	11.435	-	11.435	0	11.435	1,88
1.4 Cédulas hipotecarias	5.000.000	-	5.000.000	0	5.000.000	0	-	0	0	0	-
1.5 Préstamos a promotores	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
1.6 Préstamos a PYMES	1.757.258	-	1.757.258	36.101	1.793.359	1.845.449	-	1.845.449	22.940	1.868.389	-4,02
1.7 Préstamos a empresas	2.767	-	2.767	51.380	54.147	3.176	-	3.176	52.760	55.936	-3,20
1.8 Préstamos corporativos	0	-	0	13.798	13.798	0	-	0	8.955	8.955	54,08
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	4.257.536	-	4.257.536	55.551	4.313.087	3.610.537	-	3.610.537	53.624	3.664.161	17,71
1.14 Préstamos automoción	2.523.120	-	2.523.120	0	2.523.120	2.678.814	-	2.678.814	0	2.678.814	-5,81
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	650.161	-	650.161	0	650.161	765.376	-	765.376	0	765.376	-15,05
1.16 Cuentas a cobrar	0	-	0	93.995	93.995	0	-	0	42.001	42.001	123,79
1.17 Derechos de crédito futuros	0	-	0	148.648	148.648	0	-	0	21.442	21.442	593,26
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	1.923.460	-	1.923.460	398.953	2.322.413	1.893.594	-	1.893.594	386.552	2.280.146	1,85
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	544.092	-	544.092	23.243	567.335	563.098	-	563.098	14.018	577.116	-1,69
1.22 Intereses vencidos e impagados	5.364	-	5.364	604	5.968	13.774	-	13.774	539	14.313	-58,30
1.23 Activos dudosos -principal-	1.031.463	-	1.031.463	902.987	1.934.450	893.628	-	893.628	860.926	1.754.554	10,25
1.24 Activos dudosos -intereses-	36.597	-	36.597	4.915	41.512	33.551	-	33.551	7.409	40.960	1,35
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	-461.309	-	-461.309	-99.605	-560.914	-447.193	-	-447.193	-59.385	-506.578	10,73
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2. Derivados	207.165	-	207.165	0	207.165	352.479	-	352.479	0	352.479	-41,23
2.1 Derivados de cobertura	207.165	-	207.165	0	207.165	352.479	-	352.479	0	352.479	-41,23
2.2 Derivados de negociación	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
3. Otros activos financieros	1.172.996	-	1.172.996	389.226	1.562.222	1.245.522	-	1.245.522	379.083	1.624.605	-3,84
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	1.161.932	-	1.161.932	31.687	1.193.619	1.221.084	-	1.221.084	9.377	1.230.461	-2,99
3.4 Garantías financieras	715	-	715	0	715	3	-	3	0	3	23.733,33
3.5 Otros	10.350	-	10.350	357.539	367.889	24.436	-	24.436	369.705	394.141	-6,66
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
VI. Ajustes por periodificaciones	4.811	-	4.811	9.571	14.382	5.105	-	5.105	7.466	12.571	14,41
1. Comisiones	164	-	164	0	164	140	-	140	0	140	17,14
2. Otros	4.647	-	4.647	9.571	14.218	4.965	-	4.965	7.466	12.431	14,38
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	7.891.075	-	7.891.075	1.697.999	9.589.074	7.957.306	-	7.957.306	906.456	8.863.762	8,18
1. Tesorería	7.862.495	-	7.862.495	1.697.999	9.560.494	7.957.306	-	7.957.306	906.456	8.863.762	7,86
2. Otros activos líquidos equivalentes	28.580	-	28.580	0	28.580	0	-	0	0	0	-
TOTAL ACTIVO	125.756.085	-	125.756.085	7.497.977	133.254.062	131.550.444	-	131.550.444	6.048.981	137.599.425	-3,16

	31/12/2024					31/12/2023					
	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	97.591.069	-	97.591.069	5.221.387	102.812.456	112.820.370	-	112.820.370	4.317.789	117.138.159	-12,23
I. Provisiones a largo plazo	891.502	-	891.502	150.511	1.042.013	988.152	-	988.152	97.226	1.085.378	-4,00
1. Provisión garantías financieras	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2. Provisión por margen de intermediación	891.502	-	891.502	150.511	1.042.013	988.152	-	988.152	97.226	1.085.378	-4,00
3. Otras provisiones	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
II. Pasivos financieros a largo plazo	96.699.567	-	96.699.567	5.070.876	101.770.443	111.832.218	-	111.832.218	4.220.563	116.052.781	-12,31
1. Obligaciones y otros valores emitidos	91.405.437	-	91.405.437	4.294.706	95.700.143	106.024.348	-	106.024.348	3.648.354	109.672.702	-12,74
1.1 Series no subordinadas	72.226.138	-	72.226.138	4.575.118	76.801.256	81.478.172	-	81.478.172	3.851.929	85.330.101	-10,00
1.2 Series subordinadas	19.899.058	-	19.899.058	44.797	19.943.855	25.254.304	-	25.254.304	40.122	25.294.426	-21,15
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	-719.760	-	-719.760	-325.210	-1.044.970	-708.128	-	-708.128	-243.696	-951.824	9,79
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	4.950.612	-	4.950.612	396.161	5.346.773	5.497.872	-	5.497.872	225.110	5.722.982	-6,57
2.1 Préstamo subordinado	4.069.778	-	4.069.778	335.776	4.405.554	4.115.328	-	4.115.328	225.559	4.340.887	1,49
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	1.422.282	-	1.422.282	61.495	1.483.777	1.895.322	-	1.895.322	164	1.895.486	-21,72
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	31.210	-	31.210	0	31.210	160.030	-	160.030	0	160.030	-80,50
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	-572.658	-	-572.658	-1.110	-573.768	-672.808	-	-672.808	-802	-673.610	-14,82
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0	-	0	0	0	0	-	0	189	189	-100,00
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
3. Derivados	289.445	-	289.445	49.879	339.324	236.022	-	236.022	74.911	310.933	9,13
3.1 Derivados de cobertura	289.445	-	289.445	49.879	339.324	236.022	-	236.022	74.911	310.933	9,13
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	54.072	-	54.072	330.131	384.203	73.975	-	73.975	272.189	346.164	10,99
4.1 Garantías financieras	8.974	-	8.974	157.557	166.531	13.873	-	13.873	85.611	99.484	67,39
4.1 Otros	45.098	-	45.098	173.550	218.648	60.102	-	60.102	187.639	247.741	-11,74
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0	-	0	-976	-976	0	-	0	-1.062	-1.062	-8,10
III. Pasivos por impuesto diferido	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-

	31/12/2024					31/12/2023					
	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	27.143.684	-	27.143.684	2.323.830	29.467.514	17.036.858	-	17.036.858	1.802.462	18.839.320	56,41
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0	-	0	0	0	20	-	20	0	20	-100,00
V. Provisiones a corto plazo	143.405	-	143.405	0	143.405	0	-	0	0	0	-
1. Provisión garantías financieras	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2. Provisión por margen de intermediación	143.405	-	143.405	0	143.405	0	-	0	0	0	-
3. Otras provisiones	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
VI. Pasivos financieros a corto plazo	26.446.991	-	26.446.991	2.254.334	28.701.325	16.495.182	-	16.495.182	1.744.722	18.239.904	57,35
1. Obligaciones y otros valores emitidos	25.507.178	-	25.507.178	1.951.693	27.458.871	15.774.999	-	15.774.999	1.531.446	17.306.445	58,66
1.1 Series no subordinadas	20.110.682	-	20.110.682	2.134.823	22.245.505	13.322.639	-	13.322.639	1.742.892	15.065.531	47,66
1.2 Series subordinadas	4.533.482	-	4.533.482	531.182	5.064.664	1.468.812	-	1.468.812	524.725	1.993.537	154,05
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	-267.449	-	-267.449	-3.051.926	-3.319.375	-194.779	-	-194.779	-2.702.391	-2.897.170	14,57
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	645.273	-	645.273	86.826	732.099	731.609	-	731.609	44.228	775.837	-5,64
1.5 Intereses vencidos e impagados	485.188	-	485.188	2.250.789	2.735.977	446.720	-	446.720	1.921.992	2.368.712	15,50
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
2. Deudas con entidades de crédito	659.912	-	659.912	8.277	668.189	458.157	-	458.157	2.028	460.185	45,20
2.1 Préstamo subordinado	438.934	-	438.934	1.704	440.638	176.211	-	176.211	0	176.211	150,06
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	41.000	-	41.000	5.253	46.253	530	-	530	1.177	1.707	2.609,61
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	38.894	-	38.894	569	39.463	41.288	-	41.288	569	41.857	-5,72
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	-340.373	-	-340.373	-267	-340.640	-140.082	-	-140.082	-782	-140.864	141,82
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	22.540	-	22.540	550	23.090	25.126	-	25.126	1.011	26.137	-11,66
2.6 Intereses vencidos e impagados	458.918	-	458.918	470	459.388	355.084	-	355.084	55	355.139	29,35
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
3. Derivados	56.900	-	56.900	4.515	61.415	13.703	-	13.703	3.704	17.407	252,82
3.1 Derivados de cobertura	56.900	-	56.900	4.515	61.415	13.703	-	13.703	3.704	17.407	252,82
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	223.002	-	223.002	289.846	512.848	248.321	-	248.321	207.543	455.864	12,50
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	198.141	-	198.141	137.704	335.845	181.484	-	181.484	142.899	324.383	3,53
4.2 Garantías financieras	3.270	-	3.270	116.614	119.884	0	-	0	53.118	53.118	125,69
4.3 Otros	21.589	-	21.589	35.529	57.118	66.838	-	66.838	11.526	78.364	-27,11
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
VII. Ajustes por periodificaciones	553.287	-	553.287	69.497	622.784	541.656	-	541.656	57.740	599.396	3,90
1. Comisiones	527.512	-	527.512	30.684	558.196	516.487	-	516.487	21.962	538.449	3,67
1.1 Comisión sociedad gestora	1.590	-	1.590	763	2.353	1.597	-	1.597	561	2.158	9,04
1.2 Comisión administrador	26.642	-	26.642	1.637	28.279	25.180	-	25.180	1.530	26.710	5,87
1.3 Comisión agente financiero/pagos	255	-	255	289	544	212	-	212	66	278	95,68
1.4 Comisión variable	781.573	-	781.573	32.297	813.870	771.866	-	771.866	21.401	793.267	2,60
1.5 Otras comisiones del cedente	0	-	0	-1.731	-1.731	0	-	0	0	0	-
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	-282.806	-	-282.806	-3.438	-286.244	-282.658	-	-282.658	-2.063	-284.721	0,53
1.7 Otras comisiones	258	-	258	866	1.124	291	-	291	468	759	48,09
2. Otros	25.775	-	25.775	38.813	64.588	25.169	-	25.169	35.778	60.947	5,97
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	1.021.334	-	1.021.334	-47.241	974.093	1.693.217	-	1.693.217	-71.270	1.621.947	-39,94
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
IX. Coberturas de flujos de efectivo	1.021.334	-	1.021.334	-47.241	974.093	1.693.217	-	1.693.217	-71.270	1.621.947	-39,94
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0	-	0	0	0	0	-	0	0	0	-
TOTAL PASIVO	125.756.085	-	125.756.085	7.497.977	133.254.062	131.550.444	-	131.550.444	6.048.981	137.599.425	-3,16

Cuenta de pérdidas y ganancias agregada

CUADRO B

	BONOS/ F. PÚBLICOS			PAGARÉS/ F. PÚBLICOS			F. PRIVADOS			TOTAL		
Miles de euros	2024	2023	%	2024	2023	%	2024	2023	%	2024	2023	%
1. Intereses y rendimientos asimilados	5.617.902	4.968.256	13,08	0	0	-	595.971	583.139	2,20	6.213.873	5.551.395	11,93
1.1 Activos titulizados	5.378.192	4.748.605	13,26	0	0	-	488.737	501.078	-2,46	5.866.929	5.249.683	11,76
1.2 Otros activos financieros	239.711	219.651	9,13	0	0	-	107.234	82.063	30,67	346.945	301.714	14,99
2. Intereses y cargas asimilados	-5.014.874	-4.499.311	11,46	0	0	-	-768.493	-720.591	6,65	-5.783.367	-5.219.902	10,79
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	-4.665.427	-4.215.106	10,68	0	0	-	-735.793	-707.065	4,06	-5.401.220	-4.922.171	9,73
2.2 Deudas con entidades de crédito	-305.441	-251.467	21,46	0	0	-	-21.920	-8.240	166,02	-327.361	-259.707	26,05
2.3 Otros pasivos financieros	-44.006	-32.738	34,42	0	0	-	-10.780	-5.285	103,97	-54.786	-38.023	44,09
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	547.989	573.401	-4,43	0	0	-	3.126	1.171	166,95	551.115	574.572	-4,08
A) MARGEN DE INTERESES	1.151.017	1.042.346	10,43	0	0	-	-169.396	-136.279	-24,30	981.621	906.067	8,34
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	-4.032	-8.426	52,15	0	0	-	-1.689	7.612	-	-5.721	-814	-602,83
4.1 Resultados de derivados de negociación	0	0	-	0	0	-	0	0	-	0	0	-
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0	0	-	0	0	-	4.910	7.428	-33,90	4.910	7.428	-33,90
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0	0	-	0	0	-	0	0	-	0	0	-
4.4 Otros	-4.032	-8.426	52,15	0	0	-	-6.599	185	-	-10.631	-8.241	-29,00
5. Diferencias de cambio (neto)	0	0	-	0	0	-	-27.469	7.668	-	-27.469	7.668	-
6. Otros ingresos de explotación	2.089	1.159	80,24	0	0	-	12.768	5.540	130,47	14.857	6.699	121,78
7. Otros gastos de explotación	-1.010.921	-1.048.597	-3,59	0	0	-	-149.541	-157.721	-5,19	-1.160.462	-1.206.318	-3,80
7.1 Servicios exteriores	-25.176	-27.490	-8,42	0	0	-	-17.257	-27.834	-38,00	-42.433	-55.324	-23,30
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	-21.230	-22.218	-4,45	0	0	-	-12.472	-19.978	-37,57	-33.702	-42.196	-20,13
7.1.2 Servicios bancarios y similares	-507	-1.378	-63,21	0	0	-	-1.775	-3.548	-49,97	-2.282	-4.926	-53,67
7.1.3 Publicidad y propaganda	-1	0	-	0	0	-	0	0	-	-1	0	-
7.1.4 Otros servicios	-3.439	-3.894	-11,68	0	0	-	-3.010	-4.307	-30,11	-6.449	-8.201	-21,36
7.2 Tributos	-208	-371	-43,94	0	0	-	-35	-30	16,67	-243	-401	-39,40
7.3 Otros gastos de gestión corriente	-985.535	-1.020.736	-3,45	0	0	-	-132.250	-129.859	1,84	-1.117.785	-1.150.595	-2,85
7.3.1 Comisión sociedad gestora	-17.851	-16.840	6,00	0	0	-	-7.246	-5.945	21,88	-25.097	-22.785	10,15
7.3.2 Comisión administrador	-38.264	-42.241	-9,42	0	0	-	-36.097	-32.268	11,87	-74.361	-74.509	-0,20
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	-2.782	-2.640	5,38	0	0	-	-1.005	-1.015	-0,99	-3.787	-3.655	3,61
7.3.4 Comisión variable	-912.575	-948.565	-3,79	0	0	-	-76.861	-55.274	39,05	-989.436	-1.003.839	-1,43
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0	-3	-100,00	0	0	-	-15	0	-	-15	-3	400,00
7.3.6 Otros gastos	-14.063	-10.447	34,61	0	0	-	-11.026	-35.355	-68,81	-25.089	-45.802	-45,27
8. Deterioro de activos financieros (neto)	-280.253	-230.083	-21,81	0	0	-	-45.055	24.674	-	-325.308	-205.409	-58,37
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	-280.443	-230.138	-21,86	0	0	-	-45.055	24.674	-	-325.498	-205.464	-58,42
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	190	55	245,45	0	0	-	0	0	-	190	55	245,45
9. Dotaciones a provisiones (neto)	-46.291	-50.071	7,55	0	0	-	-53.286	-36.911	-44,36	-99.577	-86.982	-14,48
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0	0	-	0	0	-	0	0	-	0	0	-
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	-46.755	-50.382	7,20	0	0	-	-53.286	-36.911	-44,36	-100.041	-87.293	-14,60
9.3 Dotación otras provisiones	464	311	49,20	0	0	-	0	0	-	464	311	49,20
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	-4.491	-2.685	-67,26	0	0	-	10	-88	-	-4.481	-2.773	-61,59
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	192.882	296.357	-34,92	0	0	-	433.657	285.504	51,89	626.539	581.861	7,68
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0	0	-	0	0	-	0	0	-	0	0	-
12. Impuesto sobre beneficios	0	0	-	0	0	-	0	0	-	0	0	-
C) RESULTADO DEL PERIODO	0	0	-	0	0	-	0	0	-	0	0	-

Estado de flujos de efectivo agregado

CUADRO C

	BONOS/ F. PÚBLICOS			PAGARÉS/ F. PÚBLICOS			F. PRIVADOS			TOTAL		
Miles de euros	2024	2023	%	2024	2023	%	2024	2023	%	2024	2023	%
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	293.982	366.647	-19,82	0	0	-	-103.697	-187.167	44,60	190.285	179.480	6,02
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	1.256.803	1.333.976	-5,79	0	0	-	-81.370	-128.830	36,84	1.175.433	1.205.146	-2,47
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	5.370.103	4.593.879	16,90	0	0	-	275.927	328.227	-15,93	5.646.030	4.922.106	14,71
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	-4.704.843	-3.899.318	20,66	0	0	-	-362.171	-461.972	-21,60	-5.067.014	-4.361.290	16,18
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	1.749.928	1.353.359	29,30	0	0	-	35.246	17.620	100,03	1.785.174	1.370.979	30,21
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	-1.163.437	-745.932	55,97	0	0	-	-31.301	-15.666	99,80	-1.194.738	-761.598	56,87
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	136.069	103.765	31,13	0	0	-	22.523	9.097	147,59	158.592	112.862	40,52
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	-204.610	-134.417	52,22	0	0	-	-20.992	-7.307	187,29	-225.602	-141.724	59,18
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	73.592	62.641	17,48	0	0	-	-601	1.171	-	72.991	63.812	14,38
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	-954.339	-968.890	-1,50	0	0	-	-115.655	-86.726	33,36	-1.069.994	-1.055.616	1,36
2.1 Comisión sociedad gestora	-17.695	-16.641	6,33	0	0	-	-6.923	-5.613	23,34	-24.618	-22.254	10,62
2.2 Comisión administrador	-36.784	-40.459	-9,08	0	0	-	-35.996	-31.147	15,57	-72.780	-71.606	1,64
2.3 Comisión agente financiero/pagos	-2.734	-2.637	3,68	0	0	-	-1.180	-1.013	16,49	-3.914	-3.650	7,23
2.4 Comisión variable	-894.553	-905.680	-1,23	0	0	-	-63.691	-43.657	45,89	-958.244	-949.337	0,94
2.5 Otras comisiones	-2.572	-3.472	-25,92	0	0	-	-7.864	-5.297	48,46	-10.436	-8.769	19,01
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	-8.483	1.559	-	0	0	-	93.327	28.388	228,76	84.844	29.947	183,31
3.1 Pagos por garantías financieras	-822	-2.407	-65,85	0	0	-	-2.624	-5.461	-51,95	-3.446	-7.868	-56,20
3.2 Cobros por garantías financieras	150	1.841	-91,85	0	0	-	66.834	62.357	7,18	66.984	64.198	4,34
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	-1.044	-2.323	-55,06	0	0	-	0	0	-	-1.044	-2.323	-55,06
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	207	2.084	-90,07	0	0	-	0	0	-	207	2.084	-90,07
3.5 Otros pagos de explotación	-2.229.287	-2.395.909	-6,95	0	0	-	-326.814	-242.454	34,79	-2.556.101	-2.638.363	-3,12
3.6 Otros cobros de explotación	2.222.314	2.398.273	-7,34	0	0	-	355.931	213.945	66,37	2.578.245	2.612.218	-1,30
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	-360.214	-189.155	-90,43	0	0	-	895.241	240.906	271,61	535.027	51.751	933,85
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	14.740.001	14.665.500	0,51	0	0	-	2.487.811	2.153.160	15,54	17.227.812	16.818.660	2,43
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	-19.016.521	-20.049.059	-5,15	0	0	-	-3.455.328	-2.415.663	43,04	-22.471.849	-22.464.722	0,03
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	4.339.503	3.369.157	28,80	0	0	-	1.370.851	918.243	49,29	5.710.354	4.287.400	33,19
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	14.347.992	14.672.886	-2,21	0	0	-	2.422.227	1.836.756	31,88	16.770.219	16.509.642	1,58
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	8.881.049	9.958.049	-10,82	0	0	-	162.544	160.712	1,14	9.043.593	10.118.761	-10,63
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	487.610	458.254	6,41	0	0	-	181.417	359.597	-49,55	669.027	817.851	-18,20
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	67.190	63.464	5,87	0	0	-	459	417	10,07	67.649	63.881	5,90
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	52.521	68.221	-23,01	0	0	-	0	0	-	52.521	68.221	-23,01
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	-19.496.858	-21.851.717	-10,78	0	0	-	-1.395.797	-1.439.240	-3,02	-20.892.655	-23.290.957	-10,30
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	-423.196	1.825.247	-	0	0	-	491.906	-414.834	-	68.710	1.410.413	-95,13
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	2.041.340	3.964.057	-48,50	0	0	-	205.838	226.424	-9,09	2.247.178	4.190.481	-46,37
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	-2.386.606	-2.036.149	17,21	0	0	-	-26.170	-2.132	-	-2.412.776	-2.038.281	18,37
7.3 Pagos a Administraciones públicas	-634	-403	57,32	0	0	-	-853	-585	45,81	-1.487	-988	50,51
7.4 Otros cobros y pagos	-77.296	-102.258	24,41	0	0	-	313.093	-638.541	-	235.797	-740.799	-
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	-66.231	177.492	-	0	0	-	791.544	53.739	-	725.313	231.231	213,67
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	7.957.306	7.779.814	2,28	0	0	-	906.456	852.718	6,30	8.863.762	8.632.532	2,68
Efectivo o equivalentes al final del periodo	7.891.075	7.957.306	-0,83	0	0	-	1.697.999	906.456	87,32	9.589.074	8.863.762	8,18

PERIODO	DERECHOS DE CRÉDITO - PRINCIPALES RATIOS							VALORES EMTIDOS - MEJORAS		
	TA (1)	TAA (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	% ACTIVOS NO CORRIENTES EN VENTA (6)	%PÉRDIDAS REPERCUTIDAS (7)	% AVAL (8)	% FR (9)	% LÍNEA DE LIQUIDEZ (10)
Fondos de titulización públicos - bonos										
dic-24	125.756.084	7,20	1,81	1,71	4,43	0,23	-1,74	2,97	4,22	0,92
dic-23	140.629.446	7,78	1,74	1,44	3,85	0,26	-1,78	3,88	4,33	0,48
dic-22	152.083.350	5,93	1,54	1,49	6,22	0,27	-1,48	6,07	4,09	1,66
dic-21	168.944.581	4,15	1,71	1,31	2,72	0,31	-1,29	6,41	4,09	1,26
dic-20	188.864.783	3,45	1,91	1,20	1,18	0,35	-1,12	7,51	4,10	1,55
dic-19	186.061.492	3,63	1,90	1,12	3,37	0,37	-1,14	8,32	4,18	1,61
dic-18	198.923.354	3,23	1,91	0,96	1,43	0,38	-1,19	8,93	4,16	1,59
sept-18	206.423.317	3,11	1,94	0,92	1,38	0,36	-1,24	8,17	4,08	0,82
jun-18	211.095.203	3,21	1,88	0,89	0,62	0,40	-1,25	9,09	3,96	1,39
mar-18	217.679.794	2,95	1,94	0,84	0,77	0,40	-1,20	8,75	3,90	1,36
Fondos de titulización públicos - bonos - sin titulización de cédulas										
dic-24	113.572.280	8,03	2,02	1,91	4,94	0,25	-1,92	3,31	4,70	0,76
dic-23	128.436.126	8,58	1,92	1,59	4,24	0,28	-1,95	4,28	4,77	0,29
dic-22	138.217.952	6,58	1,70	1,65	6,90	0,30	-1,63	6,72	4,53	1,58
dic-21	151.067.429	4,67	1,93	1,48	3,07	0,35	-1,44	7,22	4,60	1,09
dic-20	165.650.046	3,97	2,20	1,38	1,35	0,40	-1,27	8,62	4,71	1,36
dic-19	159.473.350	4,28	2,24	1,32	3,97	0,43	-1,33	9,79	4,92	1,40
dic-18	169.167.094	3,84	2,27	1,14	1,70	0,44	-1,40	10,59	4,91	1,33
sept-18	173.237.685	3,74	2,33	1,10	1,66	0,43	-1,48	9,83	4,85	0,49
jun-18	178.094.915	3,84	2,25	1,07	0,74	0,48	-1,48	10,86	4,68	1,28
mar-18	182.079.626	3,57	2,34	1,02	0,93	0,47	-1,43	10,55	4,69	1,27
Fondos de titulización públicos - pagarés										
dic-24	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
dic-23	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
dic-22	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
dic-21	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
dic-20	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
dic-19	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
dic-18	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sept-18	469.365	-	8,20	-	-	0,14	-0,03	-	7,58	100,00
jun-18	654.862	-	0,04	-	-	0,12	-	-	10,09	100,00
mar-18	999.091	-	0,04	0,61	-25,79	0,08	-0,31	-	20,88	100,00
Fondos de titulización privados										
dic-24	7.497.978	1,54	12,61	0,17	0,68	-	-45,12	-	0,02	1,73
dic-23	6.719.981	4,00	12,24	0,11	0,02	-	-43,91	-	0,86	2,16
dic-22	6.799.361	6,90	16,14	0,10	0,05	-	-39,24	-	2,03	2,63
dic-21	7.036.757	12,92	12,37	0,10	0,02	-	-31,76	-	1,86	-
dic-20	4.318.726	0,87	35,80	0,02	-	-	-48,09	-	-	8,07
dic-19	4.497.792	0,23	23,66	-	-	-	-39,41	-	0,01	7,52
dic-18	3.890.410	-	2,25	-	-	-	-38,93	-	0,01	9,16
sept-18	3.982.391	0,01	2,41	-	-	-	-32,06	-	-	9,63
jun-18	3.846.211	0,04	2,68	-	-	-	-31,42	-	-	9,86
mar-18	3.898.749	0,03	2,70	-	-	-	-28,28	-	-	9,96

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

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	31/12/2024	70.596.002	8,07	54,28	2,08	2,12	5,04	19,36	11,76	3,98	0,52	30,34
	31/12/2023	72.686.399	9,66	55,51	2,15	1,69	6,00	19,67	11,30	3,56	0,52	30,29
Cédulas hipotecarias, territoriales y de internacionalización	31/12/2024	11.973.866	0,00	-	-	-	-	2,83	15,67	4,14	-	24,93
	31/12/2023	11.973.008	0,00	-	-	-	-	3,83	17,99	4,14	-	24,93
Préstamos a promotores	31/12/2024	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Préstamos a empresas, corporativos y PYMES	31/12/2024	4.978.534	7,34	18,47	2,64	2,95	2,53	5,92	5,50	4,19	8,61	16,91
	31/12/2023	7.166.742	4,28	21,08	1,85	1,94	2,88	6,00	4,46	4,12	7,21	15,55
Deduda subordinada y bonos de tesorería	31/12/2024	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AAPP	31/12/2024	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Consumo y automoción	31/12/2024	21.207.535	9,24	0,00	2,24	1,50	6,58	4,08	2,94	7,50	0,12	22,78
	31/12/2023	19.063.711	9,48	0,00	2,01	1,21	1,26	3,96	2,98	7,06	0,13	23,18
Cuentas a cobrar y cuotas de leasing	31/12/2024	1.600.880	15,98	3,55	0,46	0,67	1,14	4,56	4,50	3,32	13,21	20,74
	31/12/2023	2.575.031	0,77	3,56	0,22	0,32	1,28	4,71	3,38	5,25	9,95	22,52
Derechos de crédito futuros	31/12/2024	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Bonos de titulación	31/12/2024	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Otros	31/12/2024	4.674.371	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2,62	12,17	2,49	100,00	-
	31/12/2023	6.564.335	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,52	11,29	2,01	100,00	-
Pagarés	31/12/2024	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31/12/2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FONDOS PRIVADOS	31/12/2024	4.979.731	1,54	24,45	12,61	0,17	0,68	5,96	7,31	3,51	35,63	-
	31/12/2023	4.180.211	1,53	22,64	13,86	0,12	0,02	5,96	5,67	3,09	38,68	-

Información sobre los encabezados

(1) Miles de euros.

(2) Tasa de amortización anticipada.

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

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

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

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

(7) Vida residual media ponderada valorada en años.

(8) Antigüedad media ponderada valorada en años.

(9) Tipo de interés medio ponderado.

(10) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración.

PERIODO	HIPOTECARIOS	CEDULAS HIPOTECARIAS, TERRITORIALES Y DE INTERNACIONALIZACIÓN	PRÉSTAMOS A PROMOTORES	PRÉSTAMOS A EMPRESAS, CORPORATIVOS Y PYMES	DEUDA SUBORDINADA Y BONOS DE TESORERÍA	AAPP	CONSUMO Y AUTOMOCIÓN	CUENTAS A COBRAR Y CUOTAS DE LEASING	DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS	BONOS DE TITULIZACIÓN	OTROS	PAGARÉS	FONDOS PRIVADOS	TOTAL
dic.-24	107	4	0	16	0	0	40	3	0	0	1	0	65	236
dic.-23	124	4	0	16	0	0	33	3	0	0	1	0	55	236
dic.-22	130	4	0	18	0	0	34	3	0	0	1	0	53	243
dic.-21	144	6	0	19	0	0	28	3	0	0	1	0	40	241
dic.-20	162	7	0	22	0	0	26	3	0	0	1	0	33	255
dic.-19	170	10	0	22	0	0	23	2	0	0	1	0	25	256
dic.-18	177	11	0	32	0	0	24	2	0	0	2	0	19	268
sep.-18	183	12	0	33	0	0	25	3	0	0	2	1	18	278
jun.-18	183	12	0	34	1	0	24	3	0	0	2	1	19	280
mar.-18	193	12	0	35	1	0	24	3	0	0	2	1	18	289

* Datos trimestrales en el período 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	147.019
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	MULTICEDENTE	44.172
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	AHORRO CORPORACIÓN FINANCIERA	1.635.742
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	AHORRO CORPORACIÓN FINANCIERA	2.082.226
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	MULTICEDENTE	912.126
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	982.373
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	327.244
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	354.685
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	KUTXABANK	134.990
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	KUTXABANK	149.035
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	MULTICEDENTE	171
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	MULTICEDENTE	66.344
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	KUTXABANK	38.203
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	KUTXABANK	108.998
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	KUTXABANK	235.357
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO POPULAR ESPAÑOL	4.081
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO POPULAR ESPAÑOL	93.041
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	250.617
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	1.723.256
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	195.101
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	430.421
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	480.054
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	592.269
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	2.523.663
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	6.807.911
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	1.461.993
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	1.219.689
FONCAIXA FTGECAT 5, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	100.306
FONCAIXA FTGECAT 6, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	74.824
BANCAJA 10, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	469.855
BANCAJA 11, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	438.713
BANCAJA 13, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	1.057.038
BANCAJA 9, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	237.572
BANKINTER 13 FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANKINTER	216.553
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	70.430
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	371.107
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	573.573
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	570.517
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	318.855
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	565.306
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.908.943
BBVA LEASING 1, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.765
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.643.995
BBVA RMBS 1, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	477.655
BBVA RMBS 14, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	275.377
BBVA RMBS 2, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	884.294
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	2.036.971
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	9.754.379
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.429.230
BBVA RMBS 3, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	834.190
BBVA-6 FTPYME FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	804
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	RCI BANQUE SA	1.255.912
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO SANTANDER	8.337
HIPOCAT 10, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	127.903
HIPOCAT 11, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	146.329
HIPOCAT 9, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	93.957
MBS BANCAJA 4, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	216.084
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	193.930
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	107.398
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAJA RURAL DE ARAGON, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	67.740
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	187.911
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	45.213
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	38.475
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	130.074

FONDO		TIPO		GESTORA	CEDEnte	TOTAL ACTIVO (1)
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	47.388
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	287.088
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	92.111
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO CETELEM	127.991
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO CETELEM	368.844
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO CETELEM	354.432
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO CETELEM	478.830
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	SERVICIOS FINANCIEROS CARREFOUR	643.978
IM ANDBANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	ANDBANK	78.224
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	304.064
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	402.066
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	308.993
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	420.476
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	131.827
IM BCG RMBS 2, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO CAIXA GERAL	0
IM CAJAMAR 3, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	167
IM CAJAMAR 4, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	127.598
IM CAJAMAR 5, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	133.212
IM CAJAMAR 6, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJAMAR	349.610
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	198.441
IM PASTOR 4, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO PASTOR	102.906
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	RIBEIRA HOLDINGS, S.À R.L.	180.655
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	2.729
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	257.235
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	494.001
FTA UCI 14	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	194.192
FTA UCI 16	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	337.036
FTA, UCI 15	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	244.265
FTA, UCI 17	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	292.102
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	700.124
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNIÓN DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, E.F.C.	354.734
FONDO DE TITULIZACIÓN RMBS PRADO X	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	446.851
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER	265.007
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	381.290
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNIÓN DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, E.F.C.	416.374
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	2.875.058
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	3.868.859
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER	126.685
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER	100.074
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER, EFC	514.163
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACIÓN	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER E.F.C.	615.654
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER	347.768
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	464.195
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CA AUTO BANK, SPA, SUCURSAL EN ESPAÑA	46.573
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	STELLANTIS FINANCIAL SERVICES ESPAÑA, E.F.C, S.A.	77.679
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	STELLANTIS FINANCIAL SERVICES ESPAÑA, E.F.C, S.A.	276.425
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	92.881
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	68.999
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	22.719

FONDO		TIPO		GESTORA	CEDEnte	TOTAL ACTIVO (1)
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CAJA DE INGENIEROS	70.237
CEDULAS TDA 6, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	3.073.490
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	5.189.420
FTPYME TDA CAM 4, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	70.026
MADRID RMBS I, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	366.570
MADRID RMBS II, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	322.952
MADRID RMBS III FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CAIXABANK	692.059
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CETEM	871.211
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	VOLKSWAGEN BANK	755.490
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	5.392.346
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1	398.572
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	ING DIRECT	16.882.380
TDA 19 - MIXTO, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	35.249
TDA 22 - MIXTO, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	43.916
TDA 24, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	51.929
TDA 25, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	7.076
TDA 26 - MIXTO, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	72.352
TDA 27, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	139.487
TDA 28, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	122.806
TDA 29, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	121.278
TDA 30, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCA MARCH	84.997
TDA CAJAMAR 2, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	CAJAMAR	74.165
TDA CAM 4, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	88.835
TDA CAM 5, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	230.336
TDA CAM 6, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	172.497
TDA CAM 7, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	265.695
TDA CAM 8, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	231.704
TDA CAM 9, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	260.891
TDA IBERCAJA 4, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	IBERCAJA	159.312
TDA IBERCAJA 5, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	IBERCAJA	172.098
TDA IBERCAJA 6, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	IBERCAJA	301.389
TDA IBERCAJA 7, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	IBERCAJA	584.876
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	3.219.970
TDA TARRAGONA 1, FTA	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	55.916
Subtotal FTA/BONOS constituidos en periodos anteriores						109.536.396
BBVA CONSUMO 13, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	1.714.932
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	SANTANDER CONSUMER E.F.C.	754.322
BBVA CONSUMER 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	733.478
BBVA CONSUMER AUTO 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	978.457
PEPPER IBERIA CONSUMER 2024, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	PEPPER FINANCE CORPORATION, S.L.U.	269.367
SABADELL CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO SABADELL	717.090
SANTANDER CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	1.225.066
AUTO ABS SPANISH LOANS 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	STELLANTIS FINANCIAL SERVICES	613.791
SANTANDER CONSUMO 7, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	1.220.265
Subtotal FTA/BONOS constituidos en el periodo						8.226.768
Total FTA/BONOS						117.763.164
Subtotal FTA/PAGARÉS constituidos en periodos anteriores						0
Subtotal FTA/PAGARÉS constituidos en el periodo						0
Total FTA/PAGARÉS						0
Total FTA - PÚBLICOS						117.763.164

FONDO	TIPO		GESTORA		CEDEnte	TOTAL ACTIVO (1)
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	131.195
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	126.218
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	181.675
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	144.644
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	192.044
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	153.497
BANKINTER 11, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANKINTER	92.434
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	19.648
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	FTH	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	247.836
IM PASTOR 2, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO PASTOR	32.428
IM PASTOR 3, FTH	FTH	BONOS	PÚBLICO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO PASTOR	80.506
FTH UCI 12	FTH	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	109.830
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	FTH	BONOS	PÚBLICO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	UNION DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, EFC	328.277
Subtotal FTH constituidos en periodos anteriores						1.840.232
BBVA RMBS 23, FONDO DE TITULIZACION	FTH	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	5.521.624
RURAL HIPOTECARIO XX, FONDO DE TITULIZACION	FTH	BONOS	PÚBLICO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	631.064
Subtotal FTH constituidos en el periodo						6.152.688
Total FTH - PÚBLICOS						7.992.920
Total FONDOS PUBLICOS						125.756.084
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	MULTICEDENTE	87.844
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO PASTOR	10.195
FTA2015, FTA	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	CATALUNYA BANC	327.129
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	LC ASSET 2, S.À.R.L.	38.319
SLF, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	FIRE HOLDCO S.À R.L.	67.703
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	PATRIOT HOLDCO S.À.R.L.	54.844
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	NEPTUNE LUX HOLDCO, S.À.R.	629.782
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	TRADE & WORKING CAPITAL, S.A.U.	97.698
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	CREALSA INVESTMENTS SPAIN, S.A.	11.874
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	CREALSA INVESTMENTS SPAIN, S.A.	1.905
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	MULTICEDENTE	19.307
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	NPL CESION S.L.	15.124
PENSUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	PENSUM DIRECT, S.L.	5.361
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.	16.575
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	AQUISGRAN FINANCE, S.A.	199.854
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CRISAE PRIVATE DEBT S.L.	45.998
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	FUTBOL CLUB BARCELONA	1.189.250
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	GEDESCO INNOVFIN S.L.	8.407
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCA MARCH	325.676
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCA MARCH	23.631
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BANCO SABADELL	126.911
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	PERFECTA	25.850
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	SACYR INDUSTRIAL OPERACION Y MANTENIMIENTO, S.L	168.090
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	UNION FINANCIERA ASTURIANA, E.F.C., S.A.U.	180.160
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	42.162
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	174.185
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	102.398
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	5.278
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	15.578
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	82.107
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	43.911
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	50.853
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	12.988
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	ELLINGTON RESIDENTIAL HOLDINGS	548.059
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	78.015
ELECNR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	ELECNR, S.A.	41.621

FONDO		TIPO		GESTORA	CEDEnte	TOTAL ACTIVO (1)
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	55.139
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	45.037
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	DEUTSCHE BANK AG LONDON BRANCH	9.066
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	FNPL ESP INVESTMENTS DESIGNATED ACTIVITY COMPANY	90.520
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	BTL IV	127.640
Subtotal FTA/PRIVADOS/BONOS constituidos en periodos anteriores						5.202.044
BBVA VELA CORPORATE 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EUROPEA DE TITULIZACION, S.A., S.G.F.T	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	217.548
ENERGYA VM, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	ENÉRGYA VM GESTIÓN DE ENERGÍA, S.L.U.	205
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 10	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	101.748
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 11	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	236.585
TER 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, S.A.	CAIXABANK	184.123
WORKCAPITAL I, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	WORKCAPITAL, S.A.	15.836
RONDA FUNDING, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	BEKA HEALTHCARE, S.L	3.942
CASA V, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	CABIN OTHAR, S.À R	39.082
DACE, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	MULTICEDENTE	22.632
MICROWD, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	MICROWD SPV 2, SL	1.993
CASA VI, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	BALBEC EUROPE S.C.A SICAC_RAIF	441.843
OAK TRADE FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	FTA	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	17.037
FONDO DE TITULIZACION TAYRONA	FTA	BONOS	PRIVADO	SANTANDER DE TITULIZACION, SGFT, S.A.	BANCO SANTANDER	228.961
Subtotal FTA/PRIVADOS/BONOS constituidos en el periodo						1.511.535
Total FTA/PRIVADOS/BONOS						6.713.579
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	MULTICEDENTE	8.423
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.	TRADE & WORKING CAPITAL, S.A.U.	26.844
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	EBN TITULIZACION, S.A., SGFT	ZEPA FINANCE, S.L.	33.796
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	SUMMA FAF, S.L.U.	128.860
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	ALTAMAR PRIVATE EQUITY S.G.I.I.C., S.A.U.	44.605
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	FORTIA	90.377
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	INTERMONEY TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.	SUMMA ENERGY SERVICIOS FINANCIEROS	21.669
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE TITULIZACION	FTA	PAGARÉS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FT	15.722
Subtotal FTA/PRIVADOS/PAGARÉS constituidos en periodos anteriores						370.296
Subtotal FTA/PRIVADOS/PAGARÉS constituidos en el periodo						0
Total FTA/PRIVADOS/PAGARÉS						370.296
Total FTA - PRIVADOS						7.083.875
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	FTH	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	FNPL ESP INVESTMENTS DESIGNATED ACTIVITY COMPANY	149.146
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	FTH	BONOS	PRIVADO	TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.	MULTICEDENTE	59.612
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.	205.345
Subtotal FTH/PRIVADOS constituidos en periodos anteriores						414.103
Subtotal FTH/PRIVADOS constituidos en el periodo						0
Total FTH - PRIVADOS						414.103
Total FONDOS PRIVADOS						7.497.978

(1) Miles de euros.

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	40.188	0	44.600	0	0	0
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	69.545	0	73.169	10	0	196
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	254.845	0	266.424	17	0	2.239
AUTO ABS SPANISH LOANS 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	594.414	0	606.161	882	0	-2.575
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	114.081	0	113.309	4.650	-6.002	2.177
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	329.124	0	344.203	5.790	0	11.006
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	331.502	0	338.975	4.922	0	223
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	456.151	0	464.523	6.844	0	-10.532
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	122.651	0	125.226	20.281	-2.889	0
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	41.444	56	42.203	0	-13.489	-274
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	1.589.886	0	1.589.435	45.897	-9	0
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	2.038.462	0	2.038.014	42.180	0	0
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	753.509	0	783.391	124.687	-50.560	-987
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	118.929	98	125.088	5.659	-1.031	-689
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	115.345	0	117.324	8.413	-715	-133
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	165.885	706	171.696	9.694	-2.060	-183
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	136.425	542	138.358	6.048	-5.960	-697
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	168.065	289	173.243	18.505	-18.409	-2.236
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	123.266	711	124.758	28.605	-7.137	-1.893
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	871.856	1.487	879.420	102.127	-4.955	-17.829
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	274.270	876	292.778	34.024	-3.669	-6.124
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	297.948	98	318.535	35.552	-6.781	-5.943
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	103.907	0	109.344	24.048	-194	-55
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	130.568	0	136.180	10.934	-567	-514
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	0	0	149	1	-9.857	0
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	58.334	60	59.885	4.795	-758	-158
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	32.623	0	33.965	4.195	-491	-171
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	97.083	0	101.584	6.841	-307	-652
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	208.799	0	217.373	13.978	-36	-4.593
BANCAJA 10, FTA	436.573	9.508	469.432	0	-35.215	-3.298
BANCAJA 11, FTA	416.761	7.163	438.075	0	-36.578	-3.369
BANCAJA 13, FTA	871.975	12.590	891.881	164.063	-88.159	-1.254
BANCAJA 9, FTA	209.363	4.447	236.849	556	-22.868	-1.615
BANKINTER 11, FTH	82.613	0	90.420	0	-2.605	-730
BANKINTER 13 FTA	191.064	374	207.270	0	-2.697	-1.693
BBVA CONSUMER 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	662.042	0	726.728	0	0	-11.182
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	58.073	0	69.373	0	0	0
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	308.134	0	354.496	0	0	12.886
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACIÓN	520.446	0	559.647	0	0	9.060
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	551.558	0	566.260	0	0	-16.551
BBVA CONSUMER AUTO 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	952.092	0	968.369	0	0	-8.014
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	295.359	0	317.926	0	0	0
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	477.581	0	497.433	62.525	0	0
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	1.639.136	0	1.742.200	150.154	0	0
BBVA CONSUMO 13, FONDO DE TITULIZACION	1.507.294	0	1.596.691	100.122	0	0
BBVA LEASING 1, FTA	897	7	1.727	0	-98.523	-2.227
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	1.421.198	0	1.516.530	120.143	0	-7.329
BBVA RMBS 1, FTA	444.591	1.385	438.842	33.221	-12.460	-94
BBVA RMBS 14, FTA	244.835	0	246.415	28.941	-5.723	0
BBVA RMBS 2, FTA	837.885	4.570	826.850	27.567	-1.276	-1.864
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	1.751.306	0	1.784.873	125.522	0	123.691
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	8.883.916	0	9.087.695	622.426	0	-26.748
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	1.189.722	0	1.218.630	70.658	0	138.774
BBVA RMBS 23, FONDO DE TITULIZACION	5.181.682	0	5.235.753	273.360	0	-74.162
BBVA RMBS 3, FTA	805.400	2.425	829.240	0	-178.283	2.532
BBVA-6 FTPYME FTA	0	0	648	0	-45.630	0
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	80.476	34	81.901	7.438	0	-128
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	24.554	142	24.114	43.109	0	-38
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	15.070	419	10.524	7.019	0	-18
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	172.553	0	233.848	15.022	0	0
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	1.557.064	0	1.622.896	100.346	-1.514	0
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	178.785	0	184.302	9.841	0	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 PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	376.478	0	411.485	18.907	-9.346	0
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	405.737	0	453.276	23.558	0	0
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	515.430	0	559.617	31.537	0	0
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACION	2.172.913	0	2.361.715	150.859	0	0
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	6.135.799	0	6.264.094	543.788	-133.247	0
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	1.321.764	0	1.379.462	82.464	-37.520	0
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	1.152.796	0	1.173.345	46.329	-21.931	0
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	53.805	0	55.822	14.403	-2.018	0
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	1.190.177	0	1.228.465	14.016	0	0
CEDULAS TDA 6, FTA	3.070.705	0	3.070.705	0	0	0
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	584.543	0	566.258	77.710	-4.673	0
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	3.056	45	792	7.458	-15.820	-12
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	67.991	0	99.072	1.102	-15.095	-1.283
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	52.946	0	72.326	2.122	-11.162	172
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	2.073	45	2.570	0	-52.726	157
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	220.792	2.550	251.680	0	-14.010	5.449
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	454.662	7.908	480.716	0	-164.853	12.788
FTA UCI 14	181.378	110	167.261	11.617	0	0
FTA UCI 16	320.148	94	310.441	0	0	0
FTA, UCI 15	231.513	0	226.767	0	0	0
FTA, UCI 17	279.487	48	270.379	0	0	-1.365
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	4.674.371	0	3.376.885	1.253.246	0	0
FTH UCI 12	98.721	0	96.250	10.366	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	544.174	46	700.066	0	-15.680	0
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	313.322	0	315.721	5.480	-974	33.393
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	318.974	0	321.587	4.789	-1.845	194
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO X	425.647	0	428.495	6.547	-2.333	10.063
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	246.743	0	247.795	0	-2.452	3.850
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	364.193	0	365.256	4.560	-3.002	9.389
FTPYME TDA CAM 4, FTA	36.399	4.566	70.006	0	-17.469	-41
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	8.502	0	15.340	0	-4.928	-1
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	1.628	2.174	3.892	131	-28.430	6
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	83.554	7.752	92.550	0	-41.408	-2.048
HIPOCAT 10, FTA	119.532	1.980	127.172	0	-72.162	168
HIPOCAT 11, FTA	137.153	2.638	146.132	0	-135.765	-1.325
HIPOCAT 9, FTA	81.100	901	93.798	0	-12.240	-133
IM ANDBANK RMBS 1,FONDO DE TITULIZACION	69.947	0	78.139	74	-352	0
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	275.922	0	279.768	0	0	0
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	381.215	0	385.076	2	0	0
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACION	268.272	0	276.876	0	0	0
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	382.271	0	389.695	0	0	0
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	111.615	0	117.257	452	0	0
IM BCG RMBS 2, FTA	0	0	0	0	0	0
IM CAJAMAR 3, FTA	0	0	0	0	-420	0
IM CAJAMAR 4, FTA	117.989	0	125.033	0	-44	-573
IM CAJAMAR 5, FTA	123.426	0	131.196	0	-682	0
IM CAJAMAR 6, FTA	318.394	0	345.774	0	-3.094	0
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	153.825	0	150.771	45.001	-3.491	-508
IM PASTOR 2, FTH	25.241	511	23.824	5.013	-234	550
IM PASTOR 3, FTH	62.443	12.216	76.514	3.887	-57.851	-1.572
IM PASTOR 4, FTA	81.352	14.308	99.165	3.396	-15.924	-3.457
MADRID RMBS I, FTA	320.750	14.756	308.010	55.908	-47.921	-2.124
MADRID RMBS II, FTA	286.595	12.934	268.061	47.360	-58.095	-1.371
MADRID RMBS III FTA	632.970	31.236	634.709	54.164	-140.559	126
MBS BANCAJA 4, FTA	179.420	4.987	191.008	0	-2.140	-1.015
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	831.630	0	850.329	7.143	0	0
PEPPER IBERIA CONSUMER 2024, FONDO DE TITULIZACION	261.071	0	263.448	0	0	-792
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	706.417	0	599.121	14	-5.985	0
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	5.274.812	0	5.274.812	102.853	0	0
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACION	406.062	0	412.873	3.014	-6.000	0
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	167.364	39	177.312	3.183	-15.165	0
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	2.645.281	1.023	2.874.951	0	-35.757	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	
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	3.584.893	1.601	3.868.662	0	-46.058	0
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	176.377	540	184.632	0	0	-2.191
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	94.190	282	103.011	0	0	-810
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	53.308	0	54.739	12.077	-701	0
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	222.559	0	226.395	19.031	0	0
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	153.980	0	156.768	28.429	-948	0
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	35.302	0	36.591	8.144	-473	0
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	22.801	0	12.688	25.755	-1.772	0
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	116.809	0	118.435	10.688	0	0
RURAL HIPOTECARIO XX, FONDO DE TITULIZACION	591.717	0	597.538	32.867	0	0
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE TITULIZACION	376.022	0	390.051	0	0	-9.811
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	38.723	0	46.586	0	-2.459	776
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	269.602	0	279.118	0	-3.257	1.936
SABADELL CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	687.428	0	711.951	0	0	-8.345
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	115.693	0	121.887	0	0	2.131
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	92.447	0	93.335	0	0	2.651
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	479.384	0	483.462	0	0	-12.495
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	594.282	0	600.620	2.854	0	-18.990
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	736.481	0	753.135	768	-3.075	312
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	325.354	0	326.782	0	0	11.014
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	446.212	0	459.489	0	-10.154	-10.941
SANTANDER CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	1.178.013	0	1.220.461	1.483	-4.528	-23.557
SANTANDER CONSUMO 7, FONDO DE TITULIZACION	1.154.059	0	1.218.328	0	-7.701	-1.531
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	15.616.862	0	15.751.412	120.009	0	924.347
TDA 19 - MIXTO, FTA	22.407	0	22.850	12.336	0	-41
TDA 22 - MIXTO, FTA	36.161	3.985	35.911	6.028	0	-369
TDA 24, FTA	39.379	6.307	50.496	4	-13.444	-357
TDA 25, FTA	109	4.982	4.175	0	-72.143	0
TDA 26 - MIXTO, FTA	61.645	0	67.409	0	0	-84
TDA 27, FTA	124.177	12.330	129.984	9.324	-41.752	0
TDA 28, FTA	97.267	15.433	112.177	4.539	-92.350	0
TDA 29, FTA	112.736	0	114.702	0	0	-611
TDA 30, FTA	78.722	0	81.493	0	0	-305
TDA CAJAMAR 2, FTA	62.831	0	63.412	3.338	0	-85
TDA CAM 4, FTA	64.765	2.175	57.522	20.008	0	-94
TDA CAM 5, FTA	197.167	10.735	187.984	11.080	0	-1.005
TDA CAM 6, FTA	146.032	11.926	133.756	9.621	0	-926
TDA CAM 7, FTA	233.769	13.036	215.747	10.981	0	-1.355
TDA CAM 8, FTA	204.765	11.566	195.470	3.073	0	-1.407
TDA CAM 9, FTA	222.739	15.674	233.090	7.763	0	-1.113
TDA IBERCAJA 4, FTA	145.760	0	157.599	0	0	-258
TDA IBERCAJA 5, FTA	159.455	0	170.574	0	0	-689
TDA IBERCAJA 6, FTA	272.045	0	280.191	17.574	0	-2.200
TDA IBERCAJA 7, FTA	530.050	0	580.631	0	0	-3.036
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	2.986.958	0	3.015.884	58.685	0	-94
TDA TARRAGONA 1, FTA	43.481	0	50.706	0	0	-87
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	84.790	1.770	86.712	0	-22	-947
Subtotal BONOS 31/12/2024	115.031.301	283.196	116.912.617	5.610.524	-2.183.047	984.350
Subtotal BONOS 31/12/2023	120.029.620	322.832	121.799.347	5.956.029	-1.998.455	1.695.016
%Variación	-4,16	-12,28	-4,01	-5,80	9,24	-41,93
PAGARES						
Subtotal PAGARÉS 31/12/2024	0	0	0	0	0	0
Subtotal PAGARÉS 31/12/2023	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						
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE TITULIZACION	77.366	0	25.003	61.290	0	0
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	11.257	0	11.809	51	0	0
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	161.706	0	170.028	0	0	0
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	10.195	0	10.195	0	0	0
BBVA VELA CORPORATE 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	191.690	1.252	0	0
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACIÓN	78.004	0	77.851	0	-6.132	0
CASA V, FONDO DE TITULIZACION	34.448	0	30.105	0	-189	0
CASA VI, FONDO DE TITULIZACION	414.558	0	437.497	0	-27.949	0
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE TITULIZACION	92.961	0	127.667	0	-1.515	0
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACIÓN	39.519	0	35.004	0	0	-1.877
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACIÓN	45.171	0	45.924	0	-299	0
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	1.876	0	1.729	0	0	0
DACE, FONDO DE TITULIZACION	19.799	0	20.454	134	-41	0
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	33.688	0	33.371	0	-220	0
ELECNR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACIÓN	40.372	0	19.201	0	0	0
ENERGYA VM, FONDO DE TITULIZACION	194	0	119	0	-83	0
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	620.952	0	855.677	333.129	-151.652	-49.184
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 10	0	0	87.185	0	-28	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 11	0	0	198.493	1.000	-64	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	0	0	129.292	0	-6.020	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	0	0	76.641	0	-1.862	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	0	0	4.940	0	-194	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	0	0	11.273	0	-1.239	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	0	0	58.702	0	-53	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	0	0	42.193	0	-392	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	0	0	45.973	0	-1.276	0
FONDO DE TITULIZACION TAYRONA	0	0	181.340	1.000	-61	0
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	11.237	0	11.237	0	-9	0
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	352.459	0	375.450	0	-93.099	0
FTA2015, FTA	307.434	0	319.298	1.037	-3.020.074	0
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	35.809	0	38.291	0	-719	0
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	3.649	0	7.559	0	0	0
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	19.102	0	25.443	0	-446	0
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	19.074	0	15.074	0	-885	0
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	44.531	0	44.584	0	-84	0
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	82.485	0	89.144	569	0	0
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	4.706	0	2.121	0	-20.143	0
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	325.536	0	325.267	0	-256	0
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	23.533	0	23.568	0	-150	0
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	12.913	0	20.504	99	0	0
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE TITULIZACION	9.110	0	13.700	0	0	0
MICROWD, FONDO DE TITULIZACION	1.797	0	1.943	0	-11	0
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	125.869	0	126.872	0	-33	0
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACIÓN	13.239	0	13.867	0	-46	0
OAK TRADE FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	8.712	0	16.888	0	0	0
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	51.895	0	41.912	0	0	0
PENSUM ESG I, FONDO DE TITULIZACIÓN	5.239	0	5.360	0	-43	0
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	24.793	0	25.538	35	-2.210	-695
RONDA FUNDING, FONDO DE TITULIZACION	3.620	0	0	3.911	-267	0
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	163.995	0	76.101	0	0	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	
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	137.649	0	148.884	0	0	0
SLF, FONDO DE TITULIZACION	60.864	0	63.019	0	-11.736	0
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	54.338	0	54.730	20	-10.875	0
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	629.765	0	629.250	282	0	0
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	45.031	0	44.635	0	-1.804	0
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	59.608	0	59.505	0	-8.298	0
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	9.066	0	9.059	0	-3.493	0
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	84.332	0	86.810	0	0	0
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	122.167	0	119.513	0	0	0
TER 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	150.618	332	0	0
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	57.821	0	95.926	0	0	0
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE TITULIZACION	170.226	0	177.556	0	0	0
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	188.240	0	41.357	0	0	0
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	15.733	0	16.460	0	-8.976	0
WORKCAPITAL I, FONDO DE TITULIZACION	12.092	0	0	298	0	0
Subtotal PRIVADOS 31/12/2024	4.979.735	0	6.246.399	404.439	-3.382.926	-51.756
Subtotal PRIVADOS 31/12/2023	4.180.211	0	5.179.800	227.138	-2.950.796	-74.974
%Variación	19,13	-	20,59	78,06	14,64	-30,97
Total 31/12/2024	120.011.036	283.196	123.159.016	6.014.963	-5.565.973	932.594
Total 31/12/2023	124.209.831	322.832	126.979.147	6.183.167	-4.949.251	1.620.042
%Variación	-3,38	-12,28	-3,01	-2,72	12,46	-42,43

Importe pendiente derechos de crédito

CUADRO A.1.1

Miles de euros

FONDO	HIPOTECARIOS	CEDULAS HIPOTECARIAS, TERRITORIALES Y DE INTERNACIONALIZACIÓN	PRÉSTAMOS A PROMOTORES	PRÉSTAMOS A EMPRESAS, CORPORATIVOS Y PYMES	DEUDA SUBORDINADA Y BONOS DE TESORERÍA	AAPP	CONSUMO Y AUTOMOCIÓN	CUENTAS A COBRAR Y CUOTAS DE LEASING	DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS	BONOS DE TITULIZACIÓN	OTROS	PAGARÉS	PRIVADOS	DUDOSOS - DETERIORO	INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES	
BONOS																
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	74.366	3.000	0
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	10.678	142	438
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	161.367	0	338
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	0	0	0	39.552	0	0	0	0	0	-	-	443	194
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	68.807	0	0	0	0	0	-	-	273	465
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	253.111	0	0	0	0	0	-	-	461	1.273
AUTO ABS SPANISH LOANS 2024-1, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	591.248	0	0	0	0	0	-	-	1	3.165
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	113.023	0	0	0	0	0	-	-	441	617
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	326.522	0	0	0	0	0	-	-	963	1.640
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	328.133	0	0	0	0	0	-	-	1.632	1.736
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	451.965	0	0	0	0	0	-	-	1.781	2.406
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	9.876	0	319
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	120.796	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.540	315
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	40.415	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	975	55
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	0	1.545.000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	44.886
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	745.054	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	6.914	1.541
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	118.528	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	210	190
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	114.889	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	262	194
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	164.902	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	692	290
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	136.031	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	167	227
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	167.527	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	269	268
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	122.567	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	496	203
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	866.361	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.046	1.449
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	271.427	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.388	455
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	295.762	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.734	453
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	103.258	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	444	205
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	129.001	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.285	282
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	57.810	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	417	106
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	32.401	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	148	73
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	96.811	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	21	251
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	206.434	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.763	603
BANCAJA 10, FTA	403.128	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	32.255	1.190
BANCAJA 11, FTA	385.422	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	30.197	1.142
BANCAJA 13, FTA	843.252	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	26.172	2.551
BANCAJA 9, FTA	190.146	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	18.680	537
BANKINTER 11, FTH	80.850	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.619	144
BANKINTER 13 FTA	186.409	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.321	334
BBVA CONSUMER 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	656.742	0	0	0	0	0	-	-	4.825	475
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE	0	0	0	0	0	0	57.375	0	0	0	0	0	-	-	500	198
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	305.284	0	0	0	0	0	-	-	1.829	1.021
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	515.904	0	0	0	0	0	-	-	2.976	1.566
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	546.076	0	0	0	0	0	-	-	3.629	1.853
BBVA CONSUMER AUTO 2024-1, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	947.491	0	0	0	0	0	-	-	738	3.863

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
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	0	0	0	291.077	0	0	0	0	-	-	4.041	241
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	0	0	0	471.938	0	0	0	0	-	-	5.273	370
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	0	0	0	1.626.503	0	0	0	0	-	-	11.892	741
BBVA CONSUMO 13, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	0	0	0	1.486.137	0	0	0	0	-	-	19.685	1.472
BBVA LEASING 1, FTA	0	0	0	0	0	0	0	896	0	0	0	-	-	-1	2
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	0	0	0	0	1.415.562	0	0	0	-	-	3.276	2.360
BBVA RMBS 1, FTA	429.701	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	14.741	149
BBVA RMBS 14, FTA	243.666	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	775	394
BBVA RMBS 2, FTA	811.496	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	26.112	277
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACIÓN	1.745.226	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	5.731	349
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACIÓN	8.844.313	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	36.303	3.300
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACIÓN	1.185.630	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.871	221
BBVA RMBS 23, FONDO DE TITULIZACIÓN	5.179.847	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	729	1.106
BBVA RMBS 3, FTA	764.577	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	40.381	442
BBVA-6 FTPYME FTA	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	0
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	78.004	0
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	77.358	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.994	123
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	0	0	0	23.497	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.020	38
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	0	0	0	10.791	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.261	18
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	0	0	0	169.046	0	0	0	0	-	-	2.559	948
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	0	0	0	1.542.545	0	0	0	0	-	-	5.981	8.537
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	0	0	0	0	178.090	0	0	0	-	-	422	273
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	362.378	0	0	0	0	0	0	0	-	-	12.148	1.951
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	397.998	0	0	0	0	0	0	0	-	-	5.711	2.028
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	504.619	0	0	0	0	0	0	0	-	-	8.445	2.366
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	2.146.892	0	0	0	0	0	0	0	-	-	16.327	9.695
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACIÓN	6.016.145	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	98.388	21.266
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	1.296.770	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	21.269	3.725
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	1.115.177	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	33.908	3.712
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	53.247	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	437	121
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	1.184.681	0	0	0	0	-	-	742	4.754
CASA V, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	30.260	3.931	256
CASA VI, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	336.507	76.571	1.480
CEDULAS TDA 6, FTA	0	3.000.000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	70.705
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	86.105	0	6.856
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	35.000	0	4.519
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	584.936	0	0	0	0	-	-	5.469	-5.861
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	45.000	0	171
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.759	0	117
DACE, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	18.342	0	1.457
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	33.288	0	400
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	0	0	0	735	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.318	3
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	40.372	0	0
ENERGYA VM, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	194	0	0
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	620.952	0	0
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	0	0	0	65.035	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.721	235

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
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	0	0	0	50.022	0	0	0	0	0	0	0	0	-	2.746	179
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	0	0	0	0	0	0	2.070	0	0	0	0	-	-	0	3
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	217.920	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.403	469
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	445.418	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	8.287	957
FTA UCI 14	144.431	0	0	0	0	0	0	0	0	0	10.871	-	-	24.447	1.629
FTA UCI 16	261.407	0	0	0	0	0	0	0	0	0	12.432	-	-	43.811	2.498
FTA, UCI 15	188.249	0	0	0	0	0	11.527	0	0	0	0	-	-	30.117	1.620
FTA, UCI 17	237.118	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	39.970	2.399
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	4.674.371	-	-	0	0
FTH UCI 12	89.814	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	8.050	857
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 10	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 11	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	0	0	0	527.380	0	0	0	0	0	0	0	-	-	15.016	1.778
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	312.938	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	366	18
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	318.946	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	28
FONDO DE TITULIZACIÓN RMBS PRADO X	425.615	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	32
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER	0	0	0	0	0	0	244.750	0	0	0	0	-	-	1.007	986
FONDO DE TITULIZACION TAYRONA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	11.219	0	18
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	223.335	128.260	864
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	364.137	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	56
FTA2015, FTA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	24.874	282.289	271
FTPYME TDA CAM 4, FTA	0	0	0	27.462	0	0	0	0	0	0	0	-	-	8.895	41
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	8.292	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	198	12
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	0	0	0	1.628	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	1
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	76.686	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	6.848	21
HIPOCAT 10, FTA	116.695	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.788	49
HIPOCAT 11, FTA	133.720	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.367	66
HIPOCAT 9, FTA	79.222	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.849	29
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	35.809	0	0
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3.649	0	0
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	19.102	0	0
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	15.771	843	2.460
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	44.476	0	55
IM ANDBANK RMBS 1,FONDO DE TITULIZACION	69.831	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	116
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	274.455	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	728	739
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	379.435	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	805	975
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	263.406	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.505	2.362

Miles de euros

FONDO	HIPOTECARIOS	CEDULAS HIPOTECARIAS, TERRITORIALES Y DE INTERNACIONALIZACIÓN	PRÉSTAMOS A PROMOTORES	PRÉSTAMOS A EMPRESAS, CORPORATIVOS Y PYMES	DEUDA SUBORDINADA Y BONOS DE TESORERÍA	AAPP	CONSUMO Y AUTOMOCIÓN	CUENTAS A COBRAR Y CUOTAS DE LEASING	DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS	BONOS DE TITULIZACIÓN	OTROS	PAGARÉS	PRIVADOS	DUDOSOS - DETERIORO	INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	376.640	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.186	3.445
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	109.601	0	0	0	0	0	0	0	-	-	407	1.607
IM BCG RMBS 2, FTA	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	0
IM CAJAMAR 3, FTA	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	0
IM CAJAMAR 4, FTA	117.250	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	520	219
IM CAJAMAR 5, FTA	122.408	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	696	323
IM CAJAMAR 6, FTA	316.075	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.629	691
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	150.879	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.687	258
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	82.011	0	474
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	4.463	0	242
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	323.723	0	1.813
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	23.502	0	31
IM PASTOR 2, FTH	22.949	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.290	2
IM PASTOR 3, FTH	46.859	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	15.571	13
IM PASTOR 4, FTA	66.654	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	14.687	11
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	12.688	0	225
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	9.110	0	0
MADRID RMBS I, FTA	302.617	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	17.600	533
MADRID RMBS II, FTA	265.145	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	20.977	473
MADRID RMBS III FTA	583.035	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	48.974	960
MBS BANCAJA 4, FTA	156.621	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	22.352	447
MICROWD, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.752	0	45
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	124.240	0	1.629
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	817.952	0	0	0	0	-	-	8.790	4.888
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	13.239	0
OAK TRADE FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	8.712	0	0
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	50.060	0	1.835
PENSIUM ESG I, FONDO DE TITULIZACIÓN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	5.234	0	5
PEPPER IBERIA CONSUMER 2024, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	257.636	0	0	0	0	-	-	726	2.709
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	24.091	550	151
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	702.867	0	0	0	0	-	-	2.503	1.047
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	0	5.115.000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	159.812
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACION	405.993	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	0	69
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	96.185	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	70.535	644
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	2.584.821	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	52.772	7.688
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	3.513.235	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	62.085	9.573
RONDA FUNDING, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3.620	0	0
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	169.066	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	6.937	374
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	91.054	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.946	190
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	52.386	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	827	95
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	209.086	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	12.869	604
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	152.034	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.661	285
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	35.011	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	240	51
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	22.599	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	157	45
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	115.304	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.283	222
RURAL HIPOTECARIO XX, FONDO DE TITULIZACION	586.721	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.668	1.328

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
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE	0	0	0	0	0	0	372.575	0	0	0	0	-	-	1.328	2.120
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	38.116	0	0	0	0	-	-	571	36
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	265.868	0	0	0	0	-	-	3.507	227
SABADELL CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	686.917	0	0	0	0	-	-	0	511
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	163.996	0	0
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	137.649	0
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO	0	0	0	0	0	0	113.055	0	0	0	0	-	-	2.076	562
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO	0	0	0	0	0	0	90.887	0	0	0	0	-	-	1.173	387
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01,	0	0	0	0	0	0	473.037	0	0	0	0	-	-	1.766	4.581
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO	0	0	0	0	0	0	591.406	0	0	0	0	-	-	0	2.876
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2024-1, FONDO	0	0	0	0	0	0	732.671	0	0	0	0	0	-	0	3.810
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	322.393	0	0	0	0	-	-	1.231	1.730
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	443.724	0	0	0	0	-	-	0	2.488
SANTANDER CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	1.171.787	0	0	0	0	-	-	0	6.226
SANTANDER CONSUMO 7, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	1.147.602	0	0	0	0	-	-	0	6.457
SLF, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	14.620	46.243	0
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	40.759	13.579	0
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	629.766	0	0
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	15.518.700	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	56.450	41.712
TDA 19 - MIXTO, FTA	22.231	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	146	30
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	45.031	0
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	59.608	0
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	9.066	0
TDA 22 - MIXTO, FTA	31.592	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.513	56
TDA 24, FTA	28.600	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	10.711	68
TDA 25, FTA	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	109	0
TDA 26 - MIXTO, FTA	57.610	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	3.865	170
TDA 27, FTA	105.194	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	18.765	219
TDA 28, FTA	76.264	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	20.812	191
TDA 29, FTA	107.972	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.449	315
TDA 30, FTA	76.836	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.591	295
TDA CAJAMAR 2, FTA	62.410	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	299	122
TDA CAM 4, FTA	56.574	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	8.105	86
TDA CAM 5, FTA	179.838	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	17.061	267
TDA CAM 6, FTA	129.244	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	16.571	217
TDA CAM 7, FTA	212.286	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	21.178	304
TDA CAM 8, FTA	184.052	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	20.399	314
TDA CAM 9, FTA	202.032	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	20.384	323
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	84.332	0
TDA IBERCAJA 4, FTA	144.863	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	858	40
TDA IBERCAJA 5, FTA	158.324	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.086	45
TDA IBERCAJA 6, FTA	270.138	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.827	79
TDA IBERCAJA 7, FTA	526.989	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	2.914	146
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	2.919.756	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	64.495	2.707
TDA TARRAGONA 1, FTA	42.411	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	1.041	30
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	122.167	0
TER 1, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0	0	0

Miles de euros

FONDO	CEDULAS HIPOTECARIAS, TERRITORIALES Y DE INTERNACIONALIZACIÓN		PRÉSTAMOS A PROMOTORES	PRÉSTAMOS A EMPRESAS, CORPORATIVOS Y PYMES	DEUDA SUBORDINADA Y BONOS DE TESORERÍA	AAPP	CONSUMO Y AUTOMOCIÓN	CUENTAS A COBRAR Y CUOTAS DE LEASING	DERECHOS DE CRÉDITO FUTUROS	BONOS DE TITULIZACIÓN	OTROS	PAGARÉS	PRIVADOS	DUDOSOS - DETERIORO	INTERESES DEVENGADOS + AJUSTES	
	HIPOTECARIOS	INTERNACIONALIZACIÓN														
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	57.821	0		0
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	167.953	579		1.694
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	80.433	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	4.113		244
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	7.259	180.907		73
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	15.279	322		131
WORKCAPITAL I, FONDO DE TITULIZACION	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	12.106	-15		0
Total 31/12/2024	69.165.000	11.660.000	0	4.868.084	0	0	21.044.934	1.594.548	0	0	4.697.674	0	3.665.065	2.737.901		577.822
Total 31/12/2023	71.134.041	11.660.000	0	7.054.810	0	0	18.928.093	2.570.449	0	0	6.591.298	0	2.823.557	2.852.015		595.175
%Variación	-2,77	0,00	-	-31,00	-	-	11,18	-37,97	-	-	-28,73	-	29,80	-4,00		-2,92

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

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
FTA UCI 16	9,22	44,95	16,17	33,41	1,00	16,30	18,90	4,25	1,12	ANDALUCÍA	24,87
FTA, UCI 15	9,40	43,30	14,97	23,96	1,88	13,82	19,46	4,28	1,26	ANDALUCÍA	23,37
FTA, UCI 17	10,74	45,87	17,16	30,43	0,65	17,02	18,35	4,28	1,51	ANDALUCÍA	25,30
FTH UCI 12	10,28	34,20	8,28	10,08	1,61	11,08	20,49	4,40	2,10	MADRID	22,18
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	7,38	58,69	0,14	0,22	2,32	21,35	8,10	2,68	1,72	MADRID	32,67
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	7,55	55,86	0,02	0,12	2,95	22,16	7,96	2,67	1,50	CATALUÑA	39,13
FONDO DE TITULIZACIÓN RMBS PRADO X	6,05	62,34	0,04	0,27	8,81	22,97	7,84	2,67	1,34	CATALUÑA	34,13
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	5,35	62,45	0,06	0,26	35,55	23,10	6,82	2,51	1,46	CATALUÑA	35,30
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	7,78	18,73	2,32	3,19	0,02	3,98	18,08	3,42	6,33	CATALUÑA	80,98
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	7,30	31,09	7,78	19,79	18,08	12,15	18,68	4,75	3,52	CATALUÑA	29,35
HIPOCAT 10, FTA	6,16	39,68	2,85	24,67	0,55	9,65	19,92	4,66	1,83	CATALUÑA	69,97
HIPOCAT 11, FTA	6,03	53,16	2,73	32,60	0,28	12,25	19,17	4,62	2,16	CATALUÑA	70,39
HIPOCAT 9, FTA	5,19	32,25	2,27	13,60	0,97	9,33	20,22	4,70	1,93	CATALUÑA	69,95
IM ANDBANK RMBS 1,FONDO DE TITULIZACION	23,09	43,90	0,00	0,00	0,00	17,02	4,01	4,64	6,71	MADRID	37,80
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	11,81	49,48	0,26	0,00	0,00	18,05	14,22	5,20	1,25	ANDALUCÍA	37,82
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	7,65	60,10	0,21	0,00	0,00	20,35	8,82	4,80	0,97	ANDALUCÍA	35,55
IM CAJAMAR 4, FTA	6,11	28,25	0,44	0,00	0,00	10,22	19,25	4,61	1,52	ANDALUCÍA	39,58
IM CAJAMAR 5, FTA	5,53	28,40	0,57	0,00	0,00	10,53	18,76	4,57	1,72	ANDALUCÍA	45,95
IM CAJAMAR 6, FTA	7,23	34,28	0,51	0,00	0,00	13,62	18,04	4,51	0,87	ANDALUCÍA	38,27
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	9,08	44,13	1,90	0,00	0,00	14,74	17,95	4,44	2,58	ASTURIAS	68,41
IM PASTOR 2, FTH	7,88	19,14	10,98	0,00	0,00	5,85	21,98	4,34	4,77	CATALUÑA	33,57
IM PASTOR 3, FTH	7,06	33,58	33,53	0,00	0,00	9,31	20,44	4,44	4,51	CATALUÑA	43,08
IM PASTOR 4, FTA	9,02	34,78	32,44	0,00	0,00	10,84	19,51	4,35	3,19	CATALUÑA	29,97
MADRID RMBS I, FTA	8,61	52,11	6,26	23,74	0,08	11,46	19,51	4,66	1,01	MADRID	70,13
MADRID RMBS II, FTA	7,92	52,45	7,49	24,66	0,00	11,57	19,50	4,64	1,16	MADRID	70,41
MADRID RMBS III FTA	7,88	58,37	7,90	22,95	0,00	14,77	18,91	4,39	0,62	MADRID	66,15
MBS BANCAJA 4, FTA	7,42	29,18	12,50	8,59	0,45	9,69	18,92	4,80	1,90	C.VALENCIANA	43,05
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACION	7,64	58,17	0,14	0,00	0,00	22,01	10,85	2,62	1,52	CATALUÑA	27,94
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	6,20	94,40	44,79	0,00	0,00	18,52	17,05	5,26	3,40	GALICIA	42,98
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	10,57	79,42	3,56	0,04	12,23	23,82	9,91	4,34	0,55	MADRID	33,13
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	8,50	84,48	2,88	0,04	7,99	19,41	0,36	4,48	0,28	ANDALUCÍA	21,70
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	7,51	30,60	3,97	2,05	0,00	10,30	19,03	4,55	1,03	C.VALENCIANA	36,83
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	7,23	25,00	3,14	0,72	0,00	8,39	19,98	4,66	1,63	ANDALUCÍA	31,65
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	10,24	35,30	1,55	0,00	0,00	14,16	15,36	4,55	3,60	ARAGÓN	89,17
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	12,81	51,22	5,72	0,00	0,00	18,16	9,19	5,01	1,40	CANARIAS	42,74
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	8,18	34,04	1,08	0,00	0,00	14,52	15,45	4,58	1,36	ANDALUCÍA	34,88
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	10,26	36,63	0,68	0,00	0,00	14,51	15,44	4,57	5,16	C.LEÓN	57,01
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	11,59	43,10	0,68	0,00	0,00	17,88	12,98	4,83	6,73	ARAGÓN	52,59
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	10,42	43,75	1,10	0,00	0,00	15,79	11,64	5,08	1,96	ARAGÓN	87,85

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
RURAL HIPOTECARIO XX, FONDO DE TITULIZACION	6,82	55,34	0,61	0,00	0,00	20,11	7,82	4,73	0,75	EXTREMADURA	34,60
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	10,53	56,30	0,36	0,00	0,00	24,98	6,20	3,62	0,06	MADRID	30,22
TDA 19 - MIXTO, FTA	5,92	20,97	0,64	0,00	0,00	6,39	22,18	4,53	3,06	CATALUÑA	44,26
TDA 22 - MIXTO, FTA	4,74	34,25	12,05	10,04	0,07	9,13	21,58	4,54	3,32	CATALUÑA	42,94
TDA 24, FTA	3,99	34,42	27,03	27,06	0,08	7,85	20,79	4,75	3,81	C.LA MANCHA	43,84
TDA 26 - MIXTO, FTA	6,22	27,14	6,11	0,08	0,00	8,82	19,94	4,52	3,96	BALEARES	31,44
TDA 27, FTA	5,72	35,01	14,65	21,57	0,07	12,18	19,73	4,59	1,74	CATALUÑA	37,74
TDA 28, FTA	5,96	47,03	24,31	34,91	0,09	16,24	18,95	4,68	2,91	CATALUÑA	46,49
TDA 29, FTA	7,55	35,47	3,89	0,02	0,00	13,15	18,84	4,46	2,63	BALEARES	38,33
TDA 30, FTA	6,80	36,94	2,01	0,00	0,00	14,89	18,30	4,44	3,28	BALEARES	50,66
TDA CAJAMAR 2, FTA	5,72	23,52	0,46	0,00	0,00	8,05	20,59	4,57	1,78	ANDALUCÍA	38,94
TDA CAM 4, FTA	5,59	19,94	12,42	1,31	0,00	4,64	22,01	4,40	1,83	C.VALENCIANA	47,82
TDA CAM 5, FTA	5,65	29,94	8,66	3,12	0,12	8,86	20,91	4,47	0,82	C.VALENCIANA	35,52
TDA CAM 6, FTA	5,75	35,28	11,47	6,17	0,15	10,68	19,89	4,40	1,16	C.VALENCIANA	41,10
TDA CAM 7, FTA	5,85	36,72	9,14	5,20	0,11	11,98	19,58	4,49	1,17	C.VALENCIANA	35,19
TDA CAM 8, FTA	6,17	32,98	10,37	4,37	0,00	10,95	20,05	4,51	1,42	C.VALENCIANA	41,36
TDA CAM 9, FTA	5,95	37,04	9,14	5,49	0,28	13,54	18,62	4,50	1,40	C.VALENCIANA	40,96
TDA IBERCAJA 4, FTA	8,14	30,90	0,58	0,01	53,25	10,12	20,07	4,42	1,34	MADRID	30,39
TDA IBERCAJA 5, FTA	8,16	35,40	0,67	0,18	2,17	11,63	19,60	4,38	1,29	MADRID	28,12
TDA IBERCAJA 6, FTA	8,16	37,55	0,66	0,13	0,80	14,08	18,81	4,34	1,03	MADRID	30,04
TDA IBERCAJA 7, FTA	8,01	39,60	0,55	0,01	0,00	16,29	17,68	4,22	0,66	MADRID	34,52
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	7,84	56,16	2,20	0,00	0,00	20,18	15,30	4,11	0,35	CATALUÑA	33,46
TDA TARRAGONA 1, FTA	8,28	36,32	2,31	4,38	0,00	12,92	19,80	4,43	3,69	CATALUÑA	94,42
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	6,78	25,51	4,94	1,95	0,00	8,16	19,62	4,56	2,59	C.VALENCIANA	70,27
Total 31/12/2024	8,07	54,28	2,08	2,12	5,04	19,36	11,76	3,98	0,52		30,34
Total 31/12/2023	9,66	55,51	2,15	1,69	6,00	19,67	11,30	3,56	0,52		30,29
%Variación	-16,46	-2,22	-3,26	25,44	-16,00	-1,58	4,07	11,80	0,00		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
- (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	2,50	17,60	4,76	C.LEÓN	29,45
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	0,00	0,50	0,00	3,75	GALICIA	20,51
CEDULAS TDA 6, FTA	0,00	0,39	19,64	3,88	MADRID	21,67
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	0,00	5,24	18,84	4,25	ANDALUCÍA	27,17
Total 31/12/2024	0,00	2,83	15,67	4,14		24,93
Total 31/12/2023	0,00	3,83	17,99	4,14		24,93
%Variación	-	-26,11	-12,90	0,00		0,00

Información sobre los encabezados

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

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

Información sobre los encabezados

- (1) Tasa de amortización anticipada
- (2) Porcentaje que representa la deuda total sobre el valor de tasación de la garantía
- (3) Tasa de dudosos: cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos y el principal pendiente del total activos
- (4) Tasa de fallidos: cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en balance más el principal de los activos clasificados como fallidos
- (5) Tasa de recuperación de fallidos: cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de los fallidos al cierre del
- (6) Vida residual media ponderada valorada en años
- (7) Antigüedad media ponderada valorada en años
- (8) Tipo de interés medio ponderado
- (9) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

FONDO											TASA DE CONCENTRACIÓN	
											SECTOR	
	TAA (1)	% DEUDA / VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	POR DEUDOR (9)	CNAE	PORCENTAJE	
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	8,50	26,74	4,03	2,20	0,00	9,39	18,86	4,55	12,59	70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL	21,75	
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	8,03	29,94	29,07	3,61	0,00	7,10	19,34	4,51	28,09	70.ACTIVIDADES DE LAS SEDES CENTRALES; ACTIVIDADES DE CONSULTORÍA DE GESTIÓN EMPRESARIAL	40,23	
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	9,84	27,71	4,05	10,19	8,36	7,22	9,85	4,23	14,37	68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS	18,70	
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	8,07	33,93	1,95	8,31	6,68	6,32	6,99	3,58	19,39	55.SERVICIOS DE ALOJAMIENTO	22,12	
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	6,56	31,73	2,23	4,94	9,61	5,04	5,27	3,34	11,03	01.AGRICULTURA, GANADERÍA, CAZA Y SERVICIOS RELACIONADOS CON LAS MISMAS	15,54	
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACIÓN	6,59	0,00	1,12	0,17	0,00	5,59	2,45	3,90	4,44	01.AGRICULTURA, GANADERÍA, CAZA Y SERVICIOS RELACIONADOS CON LAS MISMAS	15,43	
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	0,65	31,79	89,24	27,31	0,06	4,73	19,89	5,22	51,27	68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS	23,24	
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	8,58	27,90	4,80	27,83	4,68	10,72	19,18	4,30	6,51	68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS	19,03	
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	8,25	29,97	6,02	26,48	3,48	11,33	18,54	4,27	5,93	47.COMERCIO AL POR MENOR, EXCEPTO DE VEHÍCULOS DE MOTOR Y MOTOCICLETAS	21,33	
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	8,26	25,35	6,74	1,24	2,30	4,74	7,85	4,79	13,54	C. INDUSTRIA MANUFACTURERA	2,18	
FTPYME TDA CAM 4, FTA	6,56	31,04	31,83	6,83	0,00	6,29	16,53	4,61	15,57	74.OTRAS ACTIVIDADES PROFESIONALES, CIENTÍFICAS Y TÉCNICAS	17,87	
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	1,18	15,87	13,73	90,76	4,36	5,02	19,20	5,13	74,84	68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS	28,97	
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	7,83	46,03	1,47	0,00	0,00	6,63	6,89	5,76	7,08	11. FABRICACIÓN DE BEBIDAS	21,05	
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	7,26	41,72	0,91	0,00	0,00	6,74	5,21	5,02	4,57	01.AGRICULTURA, GANADERÍA, CAZA Y SERVICIOS RELACIONADOS CON LAS MISMAS	26,48	
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	7,95	30,97	1,96	0,00	0,00	5,53	8,59	5,74	8,18	01.AGRICULTURA, GANADERÍA, CAZA Y SERVICIOS RELACIONADOS CON LAS MISMAS	47,97	
Total 31/12/2024	7,34	18,47	2,64	2,95	2,53	5,92	5,50	4,19	8,61		16,91	
Total 31/12/2023	4,28	21,08	1,85	1,94	2,88	6,00	4,46	4,12	7,21		15,55	
%Variación	71,50	-12,38	42,70	52,06	-12,15	-1,33	23,32	1,70	19,42		8,75	

Información sobre los encabezados

(1) Tasa de amortización anticipada

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

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

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

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

(6) Vida residual media ponderada valorada en años

(7) Antigüedad media ponderada valorada en años

(8) Tipo de interés medio ponderado

(9) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

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

Información sobre los encabezados

- (1) Tasa de amortización anticipada
- (2) Porcentaje que representa la deuda total sobre el valor de tasación de la garantía
- (3) Tasa de dudosos: cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos y el principal pendiente del total activos
- (4) Tasa de fallidos: cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en balance más el principal de los activos clasificados como fallidos
- (5) Tasa de recuperación de fallidos: cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de los fallidos al cierre del mismo periodo del año anterior.
- (6) Vida residual media ponderada valorada en años
- (7) Antigüedad media ponderada valorada en años
- (8) Tipo de interés medio ponderado
- (9) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

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

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	17,62	0,00	6,87	7,82	9,71	1,45	4,25	7,27	1,50	CATALUÑA	20,81
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	15,58	0,00	2,87	3,57	25,38	2,18	4,42	9,84	0,25	ANDALUCÍA	20,31
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	13,67	0,00	1,04	1,26	18,14	1,90	3,23	7,16	0,15	CATALUÑA	20,87
AUTO ABS SPANISH LOANS 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	1,31	0,00	0,03	0,03	0,00	3,25	1,51	7,75	0,09	CATALUÑA	20,36
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	11,28	0,00	3,45	0,00	0,00	2,85	6,12	8,01	0,23	ANDALUCÍA	19,64
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	11,94	0,00	1,10	0,00	0,00	3,47	4,35	7,16	0,15	CATALUÑA	17,98
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	13,52	0,00	1,31	0,00	0,00	4,39	2,94	7,44	0,16	ANDALUCÍA	18,06
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	11,55	0,00	0,76	0,00	0,00	5,58	1,96	7,59	0,16	ANDALUCÍA	18,34
BBVA CONSUMER 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	7,18	0,00	1,02	0,00	0,00	5,41	1,88	7,79	0,12	CATALUÑA	23,26
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	11,11	0,00	7,22	23,76	4,65	2,32	7,21	6,98	0,31	ANDALUCÍA	19,74
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	9,99	0,00	4,80	2,86	3,59	3,37	5,46	6,54	0,12	ANDALUCÍA	20,32
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACIÓN	10,05	0,00	2,98	0,02	0,00	4,17	3,84	6,18	0,09	ANDALUCÍA	20,35
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	9,06	0,00	1,98	0,01	0,00	5,30	2,53	6,61	0,09	ANDALUCÍA	22,32
BBVA CONSUMER AUTO 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	1,61	0,00	0,10	0,00	0,00	6,49	1,35	8,04	0,07	ANDALUCÍA	20,96
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	13,92	0,00	10,19	15,98	11,49	2,38	5,81	6,91	0,20	CATALUÑA	25,19
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	12,94	0,00	6,59	5,98	0,00	2,72	5,15	7,06	0,08	CATALUÑA	26,56
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	11,19	0,00	2,88	0,00	0,00	4,27	3,23	5,65	0,05	CATALUÑA	26,38
BBVA CONSUMO 13, FONDO DE TITULIZACION	9,44	0,00	2,21	0,00	0,00	4,97	2,30	7,06	0,07	CATALUÑA	26,28
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	18,83	0,00	4,60	46,52	2,90	1,75	5,51	6,59	2,95	CATALUÑA	28,07
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	9,95	0,00	1,18	2,91	70,64	3,50	2,55	6,88	0,05	CATALUÑA	29,85
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	14,67	0,00	0,18	0,00	0,00	2,35	2,39	7,74	0,05	CATALUÑA	18,29
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	5,60	4,42	0,00	0,00	10,81	20,04	0,02	ANDALUCÍA	22,58
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	9,41	0,00	2,04	98,94	0,11	5,13	21,91	2,75	5,30	MADRID	40,89
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	9,45	0,00	3,65	0,49	0,00	3,37	4,50	6,45	0,18	ANDALUCÍA	24,16
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	19,63	0,00	3,06	2,99	0,00	4,71	2,59	8,12	0,08	CATALUÑA	21,81
PEPPER IBERIA CONSUMER 2024, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2,82	0,78	14,24	0,04	ANDALUCÍA	21,03
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	8,60	0,00	1,51	0,29	4,94	2,50	3,23	3,20	0,08	CATALUÑA	20,43
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE TITULIZACION	10,90	0,00	0,71	0,02	0,00	3,54	4,42	7,14	0,13	ANDALUCÍA	22,02

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
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	10,55	0,00	43,08	12,38	6,33	1,40	6,57	6,67	0,55	CATALUÑA	37,57
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	10,84	0,00	7,35	1,12	49,96	3,56	3,85	6,93	0,22	CATALUÑA	35,20
SABADELL CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	3,18	0,00	0,00	0,00	0,00	5,63	1,34	9,13	0,11	CATALUÑA	33,58
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	10,58	0,00	6,22	5,49	0,00	2,71	5,37	7,81	0,22	ANDALUCÍA	22,13
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	9,64	0,00	4,42	2,11	0,00	3,02	5,47	6,82	0,28	ANDALUCÍA	20,97
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	10,05	0,00	2,09	0,00	0,00	3,76	3,23	6,77	0,10	ANDALUCÍA	23,29
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	8,78	0,00	1,59	0,00	0,00	5,44	2,02	8,13	0,09	ANDALUCÍA	18,73
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	1,14	0,00	1,50	0,00	0,00	5,98	1,46	8,74	0,15	ANDALUCÍA	21,01
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	16,76	0,00	8,19	3,01	0,77	2,03	5,08	6,83	0,16	MADRID	17,88
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	17,13	0,00	3,79	0,57	0,00	3,71	2,82	6,64	0,18	MADRID	19,23
SANTANDER CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	10,67	0,00	1,52	0,03	0,00	4,66	1,89	6,69	0,06	MADRID	18,32
SANTANDER CONSUMO 7, FONDO DE TITULIZACION	2,24	0,00	0,79	0,00	0,00	5,28	1,18	6,73	0,08	MADRID	18,40
Total 31/12/2024	9,24	0,00	2,24	1,50	6,58	4,08	2,94	7,50	0,12		22,78
Total 31/12/2023	9,48	0,00	2,01	1,21	1,26	3,96	2,98	7,06	0,13		23,18
%Variación	-2,53	-	11,44	23,97	422,22	3,03	-1,34	6,23	-7,69		-1,73

Información sobre los encabezados

(1) Tasa de amortización anticipada

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

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

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

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

(6) Vida residual media ponderada valorada en años

(7) Antigüedad media ponderada valorada en años

(8) Tipo de interés medio ponderado

(9) Diez primeros deudores/emisores con mayor concentración

FONDO	TAA (1)	% DEUDA / VT (2)	DUDOSOS (3)	FALLIDOS (4)	RECUPERACIÓN FALLIDOS (5)	VIDA RESIDUAL (6)	ANTIGÜEDAD (7)	INTERES (8)	TASA DE CONCENTRACIÓN		
									POR DEUDOR (9)	SECTOR	
										CNAE	PORCENTAJE
BBVA LEASING 1, FTA	0,00	0,00	98,95	7,54	6,69	1,25	18,68	4,05	7,29	43.ACTIVIDADES DE CONSTRUCCIÓN ESPECIALIZADA	13,01
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	17,54	0,00	0,41	0,00	0,00	4,52	3,82	3,24	10,08	49.TRANSPORTE TERRESTRE Y POR TUBERÍA	19,85
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	3,64	31,82	0,38	5,98	10,16	4,90	9,80	3,93	38,12	68.ACTIVIDADES INMOBILIARIAS	27,87
Total 31/12/2024	15,98	3,55	0,46	0,67	1,14	4,56	4,50	3,32	13,21		20,74
Total 31/12/2023	0,77	3,56	0,22	0,32	1,28	4,71	3,38	5,25	9,95		22,52
%Variación	n.s.	-0,28	109,09	109,38	-10,94	-3,18	33,14	-36,76	32,76		-7,90

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		2,62	12,17	2,49	100,00
Total 31/12/2024	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		2,62	12,17	2,49	100,00
Total 31/12/2023	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		3,52	11,29	2,01	100,00
%Variación	-	-	-	-	-		-25,57	7,79	23,88	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)
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	6,89	0,00	0,00	0,00	0,21	7,06	56,41
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	2,53	2,95	6,62	0,20	0,19	8,67	25,62
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,84	1,29	3,72	5,68
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,30	0,00	4,73	100,00
BBVA VELA CORPORATE 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	17,40	0,00	100,00
CASA V, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	5,15	2,77	7,67	0,00
CASA VI, FONDO DE TITULIZACION	0,00	64,66	31,16	0,00	0,00	19,21	30,66	4,75	2,62
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,19	0,98	38,67
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,00	0,00	0,00	0,00
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,96	1,18	7,93	58,33
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1,43	6,92	95,42
DACE, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,10	0,21	1,73	100,00
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,03	0,21	3,44	100,00
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACIÓN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	6,39	10,18	0,00	71,15
ENERGYA VM, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,01	0,19	7,74	100,00
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 10	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 11	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

FONDO	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 TAYRONA	0,00	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	0,00	0,08	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	4,19	98,10	49,14	0,64	9,10	21,24	14,08	5,10		1,20
FTA2015, FTA	0,00	92,20	15,91	0,00	0,00	9,43	16,36	1,74		2,46
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	100,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		34,14
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,08	0,05	2,14		8,50
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,22	-0,20	11,32		99,86
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	38,27	0,00	12,40	0,00	0,00	1,71	3,83	3,78		100,00
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	5,12		0,00
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,10	0,63		70,19
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	92,98	0,00	0,00	0,00	0,00	4,94		0,00
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,43	5,54	3,04		100,00
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2,33	5,50	2,71		100,00
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,21	1,49		42,28
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,13	0,11	0,00		97,50
MICROWD, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2,57	0,56	19,93		100,00
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	6,32	1,83	4,59		41,05
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,96	13,98	0,00		9,85
OAK TRADE FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,24	0,12	0,00		85,50
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	5,89	0,00	0,00	0,00	0,00	2,87	6,05	7,04		100,00
PENSUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	18,82	1,41	6,96		13,17
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	2,79	0,00	6,89	0,00	0,00	12,54	2,42	7,37		1,00
RONDA FUNDING, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,13	0,00	3,55		99,88
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	0,00	35,99	0,00	0,00	0,00	0,00	13,51	0,00		3,28
SLF, FONDO DE TITULIZACION	0,00	65,02	73,94	0,00	0,00	20,09	0,00	4,62		0,00
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2,95		98,02
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,30	0,00	6,88		100,00
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	10,66	0,00		99,73
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	14,96	0,00		100,00
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	7,84	0,00		100,00
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	0,00	58,84	0,00	0,00	0,00	0,00	13,49	0,00		3,54

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)
TD TITAN, FONDO DE TITULIZACION	0,00	73,27	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	9,06	0,00	4,73
TER 1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,27	0,00	4,21	86,31	0,22
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,64	1,31	11,86	0,22	
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	26,05	48,82	96,22	0,01	0,00	15,76	15,41	4,76	1,85	
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	11,97	0,00	4,52	35,84	5,07	3,67	2,69	11,28	1,87	
WORKCAPITAL I, FONDO DE TITULIZACION	0,00	0,00	0,08	0,00	0,00	0,19	0,15	0,00	55,36	
Total 31/12/2024	1,54	24,45	12,61	0,17	0,68	5,96	7,31	3,51	35,63	
Total 31/12/2023	1,53	22,64	13,86	0,12	0,02	5,96	5,67	3,09	38,68	
%Variación	0,65	7,99	-9,02	41,67	-	0,00	28,92	13,59	-7,89	

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	3.485	0	0	0	0	41.100	14	0	0	0	0,00	1,12	0,00
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	59.017	5	0	0	0	14.146	2	0	0	0	0,00	3,49	0,00
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	209.379	20	0	0	0	57.014	10	0	0	0	0,00	1,12	0,00
AUTO ABS SPANISH LOANS 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	505.000	52	0	0	0	101.000	109	0	0	0	0,00	0,99	0,00
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	94.215	37	0	0	0	25.043	14	0	0	-6.001	0,00	0,00	0,00
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	272.427	105	0	0	0	71.636	36	0	0	0	0,00	0,00	0,00
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	278.664	114	0	0	0	60.137	60	0	0	0	0,00	0,00	0,00
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	391.146	154	0	0	0	73.158	64	0	0	0	0,00	0,00	0,00
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	87.349	297	0	0	0	37.435	144	0	0	0	0,00	16,00	0,00
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	4.936	17	3.790	0	0	37.000	80	0	1.668	-5.287	0,00	0,00	0,00
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	1.545.000	44.435	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	2,89
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	510.564	1.459	0	0	0	270.366	1.003	0	0	0	0,00	0,00	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	0	0	0	0	0	124.177	909	0	0	0	0,00	4,30	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	0	0	0	0	0	117.165	158	0	0	0	0,00	7,17	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	147.776	610	0	0	0	23.190	119	0	0	0	0,00	5,04	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	0	0	0	0	0	138.165	192	0	0	0	0,00	3,74	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	0	0	0	0	0	172.500	742	0	0	0	0,00	10,34	0,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	102.578	145	0	0	0	22.000	34	0	0	0	0,00	22,18	0,00
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	760.699	559	0	0	0	118.067	96	0	0	0	0,00	11,23	0,00
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	176.716	1.873	0	0	0	112.892	1.297	0	0	0	0,00	11,18	0,00
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	189.051	2.003	0	0	0	126.034	1.448	0	0	0	0,00	11,11	0,00
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	23.094	147	0	0	0	85.500	602	0	0	0	0,00	22,10	0,00
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	53.325	317	0	0	0	82.000	537	0	0	0	0,00	7,98	0,00
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	0	0	0	0	0	6.215	5	0	513	-6.585	0,00	0,00	0,00
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	34.168	63	0	0	0	25.600	53	0	0	0	0,00	8,37	0,00
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	26.812	207	0	0	0	6.886	58	0	0	0	79,56	11,96	41,66
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	87.480	576	0	0	0	13.431	96	0	0	0	0,00	6,68	0,00
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	133.588	958	0	0	0	82.200	627	0	0	0	0,00	6,39	0,00
BANCAJA 10, FTA	0	0	0	0	0	446.938	1.788	0	23.616	-2.911	0,00	3,28	0,00
BANCAJA 11, FTA	0	0	0	0	0	425.216	2.830	0	26.155	-16.127	0,00	0,00	0,00
BANCAJA 13, FTA	574.293	3.839	0	0	0	311.300	2.449	0	0	0	0,00	16,06	0,00
BANCAJA 9, FTA	0	0	0	0	0	215.734	120	0	20.995	0	0,00	10,48	0,00
BANKINTER 11, FTH	0	0	0	0	0	90.054	366	0	0	0	0,00	5,75	0,00
BANKINTER 13 FTA	0	0	0	0	0	205.698	1.571	0	0	0	0,00	5,01	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				
BBVA CONSUMER 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	602.302	4.769	0	0	0	118.809	1.887	0	0	0	0,00	0,87	0,00
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	69.043	371	0	0	0	0,00	1,45	0,00
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	302.789	2.403	0	0	0	48.865	815	0	0	0	0,00	0,46	0,00
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACION	479.990	2.174	0	0	0	77.438	708	0	0	0	0,00	0,45	0,00
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	484.135	762	0	0	0	81.603	299	0	0	0	0,00	0,49	0,00
BBVA CONSUMER AUTO 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	886.521	1.141	0	0	0	82.089	134	0	0	0	0,00	0,48	0,00
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	125.278	13	0	0	0	192.500	192	0	0	0	0,00	0,79	0,00
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	347.474	3	0	0	0	150.000	33	0	0	0	0,00	12,56	0,00
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	1.588.769	3.265	0	0	0	150.000	463	0	0	0	0,00	8,63	0,00
BBVA CONSUMO 13, FONDO DE TITULIZACION	1.493.158	3.650	0	0	0	100.000	367	0	0	0	0,00	6,28	0,00
BBVA LEASING 1, FTA	0	0	0	0	0	34.478	132	0	0	-32.883	0,00	0,00	0,00
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	1.177.115	2.812	0	0	0	336.000	1.003	0	0	0	0,00	7,93	0,00
BBVA RMBS 1, FTA	0	0	0	0	0	438.350	493	0	0	0	0,00	5,13	0,00
BBVA RMBS 14, FTA	183.386	126	0	0	0	63.000	44	0	0	0	0,00	11,26	0,00
BBVA RMBS 2, FTA	0	0	0	0	0	825.797	1.053	0	0	0	0,00	3,33	0,00
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	1.627.796	6.910	0	0	0	150.000	657	0	0	0	0,00	7,03	0,00
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	8.681.346	33.476	0	0	0	372.000	1.480	0	0	0	0,00	6,85	0,00
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	1.170.158	6.807	0	0	0	42.000	252	0	0	0	0,00	5,77	0,00
BBVA RMBS 23, FONDO DE TITULIZACION	5.122.201	5.125	0	0	0	109.000	113	0	0	0	0,00	5,21	0,00
BBVA RMBS 3, FTA	0	0	0	0	0	893.743	3.486	0	26.306	-94.296	0,00	0,00	0,00
BBVA-6 FTPYME FTA	0	0	0	0	0	10.945	10	0	0	-10.307	0,00	0,00	0,00
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	70.727	404	0	0	0	10.704	67	0	0	0	0,00	6,14	2,71
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	0	0	0	0	0	24.000	114	0	0	0	0,00	178,13	0,00
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	0	0	0	0	0	10.523	1	0	0	0	0,00	66,06	0,00
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	233.381	467	0	0	0	0,00	10,17	0,00
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	1.401.176	1.445	0	0	0	220.000	275	0	0	0	0,00	6,17	0,00
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	184.236	67	0	0	0	0,00	7,15	0,00
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	408.142	3.343	0	0	0	0,00	5,32	0,00
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	134.075	198	0	0	0	318.500	503	0	0	0	0,00	5,15	0,00
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	202.511	27	0	0	0	357.000	79	0	0	0	0,00	5,62	0,00
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACION	1.959.276	10.205	0	0	0	390.000	2.234	0	0	0	0,00	6,38	0,00
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	4.878.148	6.795	0	0	0	1.349.000	1.963	0	28.188	0	0,00	9,12	0,00
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	1.096.140	8.597	0	0	0	272.000	2.219	0	506	0	0,00	6,17	0,00
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	917.022	1.025	0	0	0	255.000	298	0	0	0	0,00	4,13	0,00
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	51.145	165	0	0	0	4.494	18	0	0	0	0,00	21,59	0,00

Información obligaciones y otros valores negociables

CUADRO A.1.3

Miles de euros

FONDO	TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO					TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO					MEJORAS		
	IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO		IMPORTE IMPAGADO		TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS	IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO		IMPORTE IMPAGADO		TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS	% AVAL (1)	% FR (2)	% LÍNEA DE LIQUIDEZ (3)
	PRINCIPAL	INTERESES	PRINCIPAL	INTERESES		PRINCIPAL	INTERESES	PRINCIPAL	INTERESES				
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	1.120.000	946	0	0	0	107.700	96	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	184	0	0	0	152.000	73	0	0	0	0,00	0,00	0,00
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	0	0	0	0	0	783	9	0	0	0	0,00	647,30	0,00
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	34.561	268	0	0	0	64.000	786	0	12.210	-12.754	35,07	26,89	0,00
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	31.591	42	0	0	0	41.300	94	0	9.364	-10.065	43,34	25,51	0,00
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	2.616	151	11.550	0	-11.747	14.300	220	0	7.718	-22.238	0,00	0,00	0,00
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	74.554	522	0	0	0	171.100	1.413	0	6.163	-2.072	0,00	7,18	0,00
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	240.732	2.557	126.236	0	0	249.100	2.145	0	22.466	-162.520	0,00	0,00	0,00
FTA UCI 14	94.586	95	0	0	0	72.500	80	0	0	0	0,00	6,94	0,00
FTA UCI 16	173.188	234	0	0	0	136.800	219	0	0	0	0,00	4,65	0,00
FTA, UCI 15	125.650	147	0	0	0	100.840	130	0	0	0	0,00	5,05	0,00
FTA, UCI 17	158.021	198	0	0	0	112.000	160	0	0	0	0,00	4,15	0,00
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	3.309.800	75.127	0	0	0	0	0	0	0	0	100,00	0,00	22,58
FTH UCI 12	63.315	85	0	0	0	32.800	50	0	0	0	0,00	10,77	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	27.408	193	0	0	0	682.993	5.105	0	0	-15.633	0,00	10,56	0,00
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	243.115	387	0	0	0	72.100	119	0	0	0	0,00	2,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	223.157	356	0	0	0	98.000	74	0	0	0	0,00	2,00	0,00
FONDO DE TITULIZACIÓN RMBS PRADO X	364.519	581	0	0	0	63.300	95	0	0	0	0,00	2,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	208.447	184	0	0	0	41.580	36	0	0	-2.452	0,00	1,13	0,00
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	301.322	445	0	0	0	63.400	89	0	0	0	0,00	2,00	0,00
FTPYME TDA CAM 4, FTA	0	0	0	0	0	54.955	7	0	23.524	-8.481	0,00	50,19	0,00
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	0	0	0	0	0	15.982	32	0	1.972	-2.645	0,00	40,50	0,00
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	0	0	0	0	0	1.797	152	10.803	1.477	-10.337	0,00	0,00	0,00
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	52.170	57	23.037	0	0	42.700	44	0	10.463	-35.921	0,00	0,00	0,00
HIPOCAT 10, FTA	0	0	0	0	0	148.508	1.587	0	42.117	-65.041	0,00	0,00	0,00
HIPOCAT 11, FTA	0	0	0	0	0	220.630	2.425	0	49.849	-126.772	0,00	0,00	0,00
HIPOCAT 9, FTA	0	0	0	0	0	99.324	888	0	2.682	-9.096	0,00	8,05	0,00
IM ANDBANK RMBS 1,FONDO DE TITULIZACION	64.555	38	0	0	0	13.538	9	0	0	0	0,00	8,23	0,00
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACIÓN	144.609	131	0	0	0	135.000	28	0	0	0	0,00	8,05	0,00
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	290.772	0	0	0	0	94.300	4	0	0	0	0,00	3,77	0,00
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	46.687	31	0	0	0	230.000	158	0	0	0	0,00	10,84	0,00
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	191.431	127	0	0	0	198.000	136	0	0	0	0,00	6,93	0,00
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	74.016	45	0	0	0	43.018	177	0	0	0	0,00	8,14	0,00
IM BCG RMBS 2, FTA	0	0	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				
IM CAJAMAR 3, FTA	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
IM CAJAMAR 4, FTA	109.783	76	0	0	0	15.158	15	0	0	0	0,00	4,80	0,00
IM CAJAMAR 5, FTA	114.206	77	0	0	0	16.893	18	0	0	0	0,00	5,72	0,00
IM CAJAMAR 6, FTA	283.035	198	0	0	0	62.491	50	0	0	0	0,00	7,34	0,00
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	89.745	84	0	0	0	60.879	63	0	0	0	0,00	27,55	0,00
IM PASTOR 2, FTH	0	0	0	0	0	23.802	22	0	0	0	0,00	21,01	0,00
IM PASTOR 3, FTH	52.893	35	0	0	0	39.000	9	0	20	-15.442	0,00	0,00	0,00
IM PASTOR 4, FTA	65.093	43	0	0	0	34.000	26	0	2	0	0,00	0,00	0,00
MADRID RMBS I, FTA	106.892	366	0	0	0	200.000	752	0	0	0	0,00	5,56	0,00
MADRID RMBS II, FTA	87.079	301	0	0	0	180.000	681	0	0	0	0,00	4,78	0,00
MADRID RMBS III FTA	319.657	1.119	0	0	0	270.000	1.096	0	42.838	0	0,00	0,00	0,00
MBS BANCAJA 4, FTA	0	0	0	0	0	189.600	1.409	0	0	0	0,00	12,18	0,00
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	595.000	228	0	0	0	255.000	101	0	0	0	0,00	0,84	0,00
PEPPER IBERIA CONSUMER 2024, FONDO DE TITULIZACION	204.000	85	0	0	0	59.329	34	0	0	0	0,00	0,00	0,00
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	605.097	9	0	0	-5.985	0	0	0	0	0	0,00	0,99	0,00
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	5.115.000	159.813	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	2,01
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACION	272.873	315	657	0	0	137.200	151	0	1.677	0	0,00	1,53	0,00
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	133.214	547	0	0	0	135.700	253	0	918	-15.165	0,00	0,00	0,00
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	1.911.744	7.138	0	0	0	945.000	4.093	0	19.314	-12.338	0,00	5,73	0,00
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	3.038.524	11.309	0	0	0	795.000	3.389	0	64.055	-43.615	0,00	5,31	0,00
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	0	0	0	0	0	183.869	763	0	0	0	0,00	4,08	0,00
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	0	0	0	0	0	102.270	741	0	0	0	0,00	5,72	0,00
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	32.103	149	0	0	0	22.500	110	0	0	0	0,00	20,83	0,00
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	183.415	775	0	0	0	42.500	187	0	0	0	0,00	8,05	0,00
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	103.363	417	0	0	0	52.900	227	0	0	0	0,00	17,20	0,00
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	19.896	149	0	0	0	16.500	132	0	0	0	0,00	21,10	0,00
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	12.681	130	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	112,53	0,00
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	96.800	179	0	0	0	21.700	42	0	0	0	0,00	9,00	0,00
RURAL HIPOTECARIO XX, FONDO DE TITULIZACION	542.717	229	0	0	0	55.300	24	0	0	0	0,00	4,89	0,00
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE TITULIZACION	328.134	129	0	0	0	61.738	50	0	0	0	0,00	1,24	0,00
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	36.435	26	0	0	0	12.564	22	0	0	-2.459	0,00	2,55	0,00
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	186.307	151	0	0	0	92.595	189	0	0	0	0,00	1,17	0,00
SABADELL CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	601.438	541	0	0	0	110.378	155	0	0	0	0,00	1,15	0,00
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	54.895	60	0	0	0	66.862	70	0	0	0	0,00	4,48	0,00
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	93.222	113	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	2,79	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				
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	482.065	694	0	0	0	700	3	0	0	0	0,00	1,10	0,00
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	600.000	620	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	1,75	0,00
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	750.000	913	0	0	0	2.218	4	0	0	0	0,00	1,00	0,00
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	326.324	458	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	2,36	0,00
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	452.139	518	0	0	0	14.815	17	0	0	-8.000	0,00	2,17	0,00
SANTANDER CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	1.200.000	1.208	0	0	0	19.200	53	0	0	0	0,00	1,97	0,00
SANTANDER CONSUMO 7, FONDO DE TITULIZACION	1.200.000	6.348	0	0	0	15.600	163	0	0	-3.783	0,00	1,28	0,00
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	13.487.000	1.172	0	0	0	2.263.000	239	0	0	0	0,00	0,76	0,00
TDA 19 - MIXTO, FTA	11.058	7	0	0	0	11.772	14	0	0	0	0,00	51,22	0,00
TDA 22 - MIXTO, FTA	3.766	0	0	0	0	32.141	2	0	0	0	0,00	8,02	0,00
TDA 24, FTA	31.217	21	0	0	0	26.600	21	0	4.418	-11.782	0,00	0,00	0,00
TDA 25, FTA	57.318	38	0	522	-53.703	14.700	12	0	3.185	-17.896	0,00	0,00	0,00
TDA 26 - MIXTO, FTA	47.836	274	0	0	0	19.142	156	0	0	0	0,00	10,94	0,00
TDA 27, FTA	101.879	8	0	0	0	51.800	5	0	9.784	-33.493	0,00	0,00	0,00
TDA 28, FTA	154.819	901	0	0	-43.543	37.350	286	0	10.199	-47.834	0,00	0,00	0,00
TDA 29, FTA	99.708	283	0	0	0	14.650	61	0	0	0	0,00	4,28	0,00
TDA 30, FTA	70.751	6	0	0	0	10.734	1	0	0	0	0,00	5,03	0,00
TDA CAJAMAR 2, FTA	55.362	18	0	0	0	8.031	3	0	0	0	0,00	8,28	4,92
TDA CAM 4, FTA	9.503	3	0	0	0	48.000	16	0	0	0	0,00	34,78	0,00
TDA CAM 5, FTA	130.901	743	0	0	0	56.000	341	0	0	0	0,00	5,89	0,00
TDA CAM 6, FTA	91.926	523	0	0	0	41.063	244	0	0	0	0,00	5,38	0,00
TDA CAM 7, FTA	122.371	377	0	0	0	92.700	299	0	0	0	0,00	5,09	0,00
TDA CAM 8, FTA	155.504	477	0	0	0	39.335	154	0	0	0	0,00	4,36	0,00
TDA CAM 9, FTA	130.119	753	0	0	0	91.500	665	0	10.052	0	0,00	5,67	0,00
TDA IBERCAJA 4, FTA	131.672	405	0	0	0	25.414	110	0	0	0	0,00	4,46	0,00
TDA IBERCAJA 5, FTA	149.152	459	0	0	0	20.762	91	0	112	0	0,00	3,53	0,00
TDA IBERCAJA 6, FTA	248.426	821	0	0	0	30.817	127	0	0	0	0,00	6,27	0,00
TDA IBERCAJA 7, FTA	486.419	1.571	0	0	0	92.257	384	0	0	0	0,00	6,54	0,00
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	2.435.510	8.340	0	0	0	570.000	2.035	0	0	0	0,00	5,05	0,00
TDA TARRAGONA 1, FTA	35.482	12	0	0	0	15.061	8	0	142	0	0,00	14,54	0,00
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	0	0	0	0	0	86.643	69	0	0	0	0,00	6,00	0,00
Subtotal BONOS 31/12/2024	92.981.690	564.901	165.270	522	-114.978	23.708.718	80.370	10.803	484.668	-872.231	2,97	4,22	0,91
PAGARÉS													
Subtotal PAGARÉS 31/12/2024	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-	-	-

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				
PRIVADOS													
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE TITULIZACION	25.003	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	11.800	9	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	2,00	0,00
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	170.000	28	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	9.876	319	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
BBVA VELA CORPORATE 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	190.500	2.264	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACIÓN	83.984	0	0	0	-6.132	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
CASA V, FONDO DE TITULIZACION	29.200	917	0	0	-189	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
CASA VI, FONDO DE TITULIZACION	353.553	27.704	0	0	-27.950	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE TITULIZACION	127.965	1.217	0	0	-1.515	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACIÓN	35.000	4	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACIÓN	45.022	845	0	0	-299	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	1.728	1	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	1,42	0,00
DACE, FONDO DE TITULIZACION	20.402	51	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,96	0,00
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	33.284	81	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
ELECNR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACIÓN	19.200	1	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
ENERGYA VM, FONDO DE TITULIZACION	200	2	0	0	-83	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	1.007.321	7	0	0	-151.652	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 10	87.000	213	0	0	-28	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 11	197.100	1.457	0	0	-64	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	134.857	455	0	0	-6.020	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	78.252	251	0	0	-1.862	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	4.926	16	0	0	-2	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	12.194	169	0	0	-1.090	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	26.224	35	0	0	0	32.339	117	0	0	-13	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	11.718	3	0	0	-9	30.466	15	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	45.958	29	0	0	-14	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION TAYRONA	180.000	1.401	0	0	-61	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	11.219	18	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	459.036	9.513	0	0	-93.099	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
FTA2015, FTA	656.726	18.785	0	2.139.135	-2.495.349	524.725	0	0	0	-524.725	0,00	0,00	33,70
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	260.216	0	0	0	-719	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	7.387	171	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	25.827	61	0	0	-446	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	14.972	102	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	1,00
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	56.777	39	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00

Información obligaciones y otros valores negociables

CUADRO A.1.3

Miles de euros

FONDO	TOTAL PENDIENTE - NO SUBORDINADO					TOTAL PENDIENTE - SUBORDINADO					MEJORAS		
	IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO		IMPORTE IMPAGADO		TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS	IMPORTE PENDIENTE NO VENCIDO		IMPORTE IMPAGADO		TOTAL PÉRDIDAS REPERCUTIDAS A LOS PASIVOS EMITIDOS	% AVAL (1)	% FR (2)	% LÍNEA DE LIQUIDEZ (3)
	PRINCIPAL	INTERESES	PRINCIPAL	INTERESES		PRINCIPAL	INTERESES	PRINCIPAL	INTERESES				
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	87.922	1.222	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	14.527	305	0	0	-12.711	6.457	0	0	0	-6.457	0,00	1,45	0,00
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	324.456	1.067	0	0	-256	0	0	0	0	0	0,00	0,04	0,00
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	23.700	18	0	0	-150	0	0	0	0	0	0,00	0,21	0,00
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	20.220	283	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE TITULIZACION	13.700	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
MICROWD, FONDO DE TITULIZACION	1.900	55	0	0	-11	0	0	0	0	0	0,00	4,50	0,00
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	124.720	2.185	0	0	-33	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	13.477	435	0	0	-46	0	0	0	0	0	0,00	0,37	0,00
OAK TRADE FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	16.888	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	41.912	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
PENSIUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	5.400	3	0	0	-43	0	0	0	0	0	0,00	1,00	0,00
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	19.362	3	0	0	0	6.945	30	0	296	-1.100	0,00	0,00	0,00
RONDA FUNDING, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	76.000	101	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	148.884	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
SLF, FONDO DE TITULIZACION	74.672	83	0	0	-11.736	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	64.472	272	0	860	-10.875	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	516.373	2.379	0	110.498	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	46.440	0	0	0	-1.804	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	67.803	0	0	0	-8.298	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	12.552	0	0	0	-3.493	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	86.810	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	119.513	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TER 1, FONDO DE TITULIZACION	140.000	10.618	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	95.000	926	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE TITULIZACION	139.232	428	0	0	0	37.851	45	0	0	0	0,00	0,00	0,00
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	41.357	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	25.200	64	0	0	-8.804	0	0	0	0	0	0,00	1,00	0,00
WORKCAPITAL I, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00	0,00	0,00
Subtotal PRIVADOS 31/12/2024	6.796.919	86.615	0	2.250.493	-2.844.843	638.783	207	0	296	-532.295	0,00	0,02	1,73
Total 31/12/2024	99.778.609	651.516	165.270	2.251.015	-2.959.821	24.347.501	80.577	10.803	484.964	-1.404.526	2,82	4,01	0,95

(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

	MARGEN DE INTERESES		GASTOS DE EXPLOTACIÓN				RTDO ACTIVOS NC
FONDO	IMPORTE	% / TA (1)	IMPORTE	% / TA (2)	% COMISIONES (3)	DETERIORO	EN VENTA (4)
BONOS							
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	335	0,72	-273	-0,59	-0,43	-649	0
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	8.680	11,17	-9.751	-12,55	-12,44	-299	0
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	16.525	5,98	-15.882	-5,75	-5,71	-770	0
AUTO ABS SPANISH LOANS 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	7.838	1,28	-2.030	-0,33	-0,05	0	0
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	11.278	8,81	-15.313	-11,96	-11,91	2.110	0
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	29.859	8,10	-32.240	-8,74	-8,72	2.381	0
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	14.182	4,00	-14.641	-4,13	-4,10	459	0
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	15.034	3,14	-13.370	-2,79	-2,77	-1.665	0
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	-55	-0,04	-126	-0,09	-0,07	0	0
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	-571	-1,29	-87	-0,20	-0,08	257	18
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	82	0,00	-82	-0,01	0,00	0	0
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	158	0,01	-143	-0,01	0,00	0	0
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	14.914	1,64	-368	-0,04	-0,03	534	0
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	63	0,05	-116	-0,09	-0,06	118	2
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	214	0,17	-119	-0,09	-0,07	93	0
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	-5	0,00	-148	-0,08	-0,05	-249	36
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	-575	-0,40	-158	-0,11	-0,06	51	71
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	-2.179	-1,13	-117	-0,06	-0,04	-52	5
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	-1.667	-1,09	-135	-0,09	-0,06	-3	24
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	-5.620	-0,57	-445	-0,05	-0,03	2.016	117
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	-2.051	-0,63	-175	-0,05	-0,03	188	8
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	-2.405	-0,68	-168	-0,05	-0,04	141	1
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	-175	-0,13	-85	-0,06	-0,06	66	0
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	-117	-0,08	-208	-0,14	-0,13	-241	0
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	-303	-177,13	-53	-30,91	-22,36	0	0
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	123	0,19	-517	-0,78	-0,70	419	4
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	49	0,13	-102	-0,27	-0,06	-40	0
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	-362	-0,33	-107	-0,10	-0,06	162	0
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	281	0,12	-1.252	-0,53	-0,53	1.318	0
BANCAJA 10, FTA	55	0,01	-615	-0,13	-0,03	-226	455
BANCAJA 11, FTA	-313	-0,07	-455	-0,10	-0,03	-395	229
BANCAJA 13, FTA	-6.960	-0,66	-852	-0,08	-0,02	-2.917	844
BANCAJA 9, FTA	-1.188	-0,50	-270	-0,11	-0,05	11	330
BANKINTER 11, FTH	-141	-0,15	-93	-0,10	-0,08	0	0
BANKINTER 13 FTA	193	0,09	-139	-0,06	-0,04	55	-23
BBVA CONSUMER 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	15.241	2,08	-13.044	-1,78	-1,77	-2.197	0
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	3.807	5,41	-3.926	-5,57	-5,49	119	0
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	20.275	5,46	-17.279	-4,66	-4,60	-3.069	0
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACIÓN	22.384	3,90	-16.445	-2,87	-2,85	-5.939	0
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	12.121	2,12	-5.562	-0,97	-0,96	-6.559	0
BBVA CONSUMER AUTO 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	13.890	1,42	-13.644	-1,39	-1,39	-246	0
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	23.811	7,47	-16.862	-5,29	-5,26	-6.949	0
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	44.879	7,94	-34.169	-6,04	-6,03	-10.710	0
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	67.589	3,54	-38.688	-2,03	-2,02	-28.901	0
BBVA CONSUMO 13, FONDO DE TITULIZACION	68.984	4,02	-54.018	-3,15	-3,15	-14.966	0
BBVA LEASING 1, FTA	-4.363	-247,20	-81	-4,59	-3,57	1.052	155
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	13.276	0,81	-10.655	-0,65	-0,64	-2.621	0
BBVA RMBS 1, FTA	1.344	0,28	-264	-0,06	-0,03	-143	-379
BBVA RMBS 14, FTA	-1.608	-0,58	-188	-0,07	-0,04	0	0
BBVA RMBS 2, FTA	6.677	0,76	-668	-0,08	-0,03	-486	-913
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	21.622	1,06	-21.456	-1,05	-1,05	-166	0
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	62.811	0,64	-61.231	-0,63	-0,63	-1.580	0

Miles de euros

FONDO	MARGEN DE INTERESES		GASTOS DE EXPLOTACIÓN			DETERIORO	RTDO ACTIVOS NC EN VENTA (4)
	IMPORTE	% / TA (1)	IMPORTE	% / TA (2)	% COMISIONES (3)		
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	8.211	0,57	-8.136	-0,57	-0,56	-75	0
BBVA RMBS 23, FONDO DE TITULIZACION	19.535	0,35	-19.510	-0,35	-0,35	-25	0
BBVA RMBS 3, FTA	-1.917	-0,23	-672	-0,08	-0,03	-901	-1.276
BBVA-6 FTPYME FTA	-1.065	-132,46	-757	-94,15	-6,59	-521	526
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	66	0,07	-994	-1,07	-1,02	-1	29
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	-764	-1,11	-811	-1,17	-1,12	30	0
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	-100	-0,44	-215	-0,95	-0,68	-111	22
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	16.741	6,68	-12.116	-4,83	-4,81	-4.624	0
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	37.606	2,18	-819	-0,05	-0,04	-41.820	0
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	8.374	4,29	-8.898	-4,56	-4,53	525	0
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	-4.150	-0,96	-258	-0,06	-0,04	-90	0
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	13.634	2,84	-13.246	-2,76	-2,75	-387	0
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	18.667	3,15	-16.163	-2,73	-2,72	-2.504	0
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACION	42.015	1,66	-31.155	-1,23	-1,23	-10.860	0
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	-13.872	-0,20	-1.431	-0,02	-0,02	-11.874	0
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	-12.196	-0,83	-557	-0,04	-0,03	-2.712	0
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	-3.868	-0,32	-502	-0,04	-0,04	-3.179	0
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	-159	-0,23	-121	-0,17	-0,11	0	0
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	44.594	3,55	-43.615	-3,47	-3,47	-979	0
CEDULAS TDA 6, FTA	338	0,01	-8	0,00	0,00	0	0
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	86.402	13,42	-85.818	-13,33	-13,31	-5.258	0
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	-739	-8,86	-59	-0,71	-0,41	16	0
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	-514	-0,51	-140	-0,14	-0,10	614	0
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	-299	-0,40	-123	-0,16	-0,12	-160	0
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	-1.911	-70,03	-109	-3,99	-3,44	605	-42
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	899	0,35	-249	-0,10	-0,04	-1.665	-397
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	-3.581	-0,72	-490	-0,10	-0,03	-4.755	-509
FTA UCI 14	-117	-0,06	-2.284	-1,18	-1,16	2.058	343
FTA UCI 16	-35	-0,01	-5.823	-1,73	-1,72	5.865	-7
FTA, UCI 15	290	0,12	-4.029	-1,65	-1,63	3.123	616
FTA, UCI 17	-186	-0,06	-5.665	-1,94	-1,93	5.847	4
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	20.168	0,39	-744	-0,01	0,00	0	0
FTH UCI 12	205	0,19	-631	-0,57	-0,54	222	204
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	2.309	0,33	-296	-0,04	-0,04	4.202	0
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	6.036	1,70	-4.907	-1,38	-1,37	77	-467
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	1.715	0,52	-595	-0,18	-0,16	114	0
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO X	5.963	1,33	-4.387	-0,98	-0,97	114	-1.078
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	18.807	7,10	-18.832	-7,11	-7,08	-1.633	0
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	7.679	2,01	-5.899	-1,55	-1,53	341	-388
FTPYME TDA CAM 4, FTA	-1.255	-1,79	-303	-0,43	-0,05	96	0
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	-528	-2,69	-85	-0,43	-0,23	1	0
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	-1.315	-32,23	-174	-4,25	-0,83	255	36
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	-1.620	-1,74	-637	-0,68	-0,12	1.941	169
HIPOCAT 10, FTA	-3.504	-2,74	-263	-0,21	-0,05	880	-229
HIPOCAT 11, FTA	-6.070	-4,15	-335	-0,23	-0,06	661	-236
HIPOCAT 9, FTA	-456	-0,49	-185	-0,20	-0,06	710	-55
IM ANDBANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	512	0,65	-512	-0,65	-0,54	0	0
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	4.492	1,48	-4.525	-1,49	-1,47	34	0
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	20.458	5,09	-20.483	-5,09	-5,08	24	0
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACION	6.295	2,04	-6.610	-2,14	-2,11	314	0
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	4.550	1,08	-5.208	-1,24	-1,22	658	0
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	6.580	4,99	-6.307	-4,78	-4,71	-273	0
IM BCG RMBS 2, FTA	426	-	-426	-	-	0	0
IM CAJAMAR 3, FTA	445	267,17	-445	-267,17	-246,00	0	0

Miles de euros

FONDO	MARGEN DE INTERESES		GASTOS DE EXPLOTACIÓN			DETERIORO	RTDO ACTIVOS NC EN VENTA (4)
	IMPORTE	% / TA (1)	IMPORTE	% / TA (2)	% COMISIONES (3)		
IM CAJAMAR 4, FTA	346	0,27	-346	-0,27	-0,24	0	0
IM CAJAMAR 5, FTA	386	0,29	-386	-0,29	-0,25	0	0
IM CAJAMAR 6, FTA	198	0,06	-198	-0,06	-0,04	0	0
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	-1.478	-0,74	-157	-0,08	-0,05	6	0
IM PASTOR 2, FTH	145	0,45	-133	-0,41	-0,22	-3	-54
IM PASTOR 3, FTH	-1.941	-2,41	-625	-0,78	-0,06	-180	-37
IM PASTOR 4, FTA	-928	-0,90	-995	-0,97	-0,05	71	-203
MADRID RMBS I, FTA	-1.614	-0,44	-602	-0,16	-0,03	-528	705
MADRID RMBS II, FTA	-1.788	-0,55	-576	-0,18	-0,04	-482	312
MADRID RMBS III FTA	-4.725	-0,68	-1.357	-0,20	-0,03	-172	1.233
MBS BANCAJA 4, FTA	721	0,33	-253	-0,12	-0,03	-285	8
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	28.756	3,30	-19.653	-2,26	-2,25	-9.254	0
PEPPER IBERIA CONSUMER 2024, FONDO DE TITULIZACION	12.820	4,76	-12.577	-0,05	-4,03	-244	0
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	13.094	1,73	-15.028	-1,99	-1,98	-2.758	0
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	26	0,00	-9	0,00	0,00	0	0
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACION	-1.646	-0,40	-149	-0,04	-0,03	-90	0
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	-610	-0,34	-2.000	-1,11	-0,92	-2.886	0
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	267	0,01	-908	-0,03	-0,03	-13.025	-254
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	9.532	0,25	-1.157	-0,03	-0,03	-18.258	-637
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	915	0,47	-955	-0,49	-0,46	0	40
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	559	0,52	-560	-0,52	-0,48	0	1
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	81	0,12	-89	-0,13	-0,06	0	0
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	1.525	0,62	-1.531	-0,62	-0,58	6	0
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	366	0,19	-110	-0,06	-0,03	0	0
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	38	0,08	-79	-0,17	-0,07	0	0
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	-193	-0,50	-82	-0,21	-0,08	0	0
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	847	0,65	-847	-0,65	-0,60	0	0
RURAL HIPOTECARIO XX, FONDO DE TITULIZACION	2.899	0,46	-2.281	-0,36	-0,35	-10	0
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE TITULIZACION	9.096	2,28	-5.014	-1,26	-1,00	-1.427	0
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	3.534	7,46	-166	-0,35	-0,19	-1.295	0
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	8.631	3,01	-346	-0,12	-0,09	-10.926	0
SABADELL CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	11.724	1,63	-11.724	-1,63	-1,63	0	0
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	11.451	9,04	-10.648	-8,41	-8,35	-803	0
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	7.568	7,56	-7.138	-7,13	-7,08	-430	0
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	20.529	3,99	-19.258	-3,75	-3,73	-1.944	0
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	19.239	3,12	-14.176	-2,30	-2,29	-5.063	0
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	9.862	1,31	-1.796	-0,24	-0,03	-11.141	0
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	30.411	8,74	-27.323	-7,86	-7,84	-3.088	0
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	8.100	1,74	-258	-0,06	-0,04	-12.509	0
SANTANDER CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	16.636	1,36	-2.499	-0,20	-0,02	-18.665	0
SANTANDER CONSUMO 7, FONDO DE TITULIZACION	5.425	0,44	-3.997	-0,33	0,00	-9.129	0
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	71.842	0,43	-48.826	-0,29	-0,29	14	0
TDA 19 - MIXTO, FTA	-329	-0,93	-74	-0,21	-0,20	0	0
TDA 22 - MIXTO, FTA	-407	-0,93	-433	-0,98	-0,28	-40	-202
TDA 24, FTA	3.962	7,63	-573	-1,10	-0,30	-331	-178
TDA 25, FTA	4.517	63,83	-2.022	-28,57	-0,98	-7.042	-1.826
TDA 26 - MIXTO, FTA	154	0,21	-639	-0,88	-0,83	0	0
TDA 27, FTA	-1.993	-1,43	-1.145	-0,82	-0,06	-191	-597
TDA 28, FTA	-4.363	-3,55	-1.409	-1,15	-0,07	-1.056	-771
TDA 29, FTA	543	0,45	-679	-0,56	-0,53	0	0
TDA 30, FTA	367	0,43	-575	-0,68	-0,63	19	0
TDA CAJAMAR 2, FTA	609	0,82	-852	-1,15	-1,09	0	0
TDA CAM 4, FTA	343	0,39	-1.544	-1,74	-1,59	2	0
TDA CAM 5, FTA	1.318	0,57	-2.604	-1,13	-0,76	-132	-110

Miles de euros

FONDO	MARGEN DE INTERESES		GASTOS DE EXPLOTACIÓN			DETERIORO	RTDO ACTIVOS NC EN VENTA (4)
	IMPORTE	% / TA (1)	IMPORTE	% / TA (2)	% COMISIONES (3)		
TDA CAM 6, FTA	742	0,43	-807	-0,47	-0,05	-248	-35
TDA CAM 7, FTA	1.573	0,59	-3.201	-1,20	-0,88	-233	-16
TDA CAM 8, FTA	1.007	0,43	-2.550	-1,10	-0,74	-232	-12
TDA CAM 9, FTA	498	0,19	-1.287	-0,49	-0,04	-490	-108
TDA IBERCAJA 4, FTA	370	0,23	-867	-0,54	-0,53	26	0
TDA IBERCAJA 5, FTA	1.948	1,13	-995	-0,58	-0,55	6	0
TDA IBERCAJA 6, FTA	137	0,05	-1.750	-0,58	-0,57	4	0
TDA IBERCAJA 7, FTA	225	0,04	-2.874	-0,49	-0,49	0	0
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	15.410	0,48	-607	-0,02	-0,02	-253	0
TDA TARRAGONA 1, FTA	-93	-0,17	-97	-0,17	-0,09	2	0
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	130	0,14	-149	-0,16	-0,08	0	0
Subtotal BONOS 2024	1.151.017	0,92	-1.010.920	-0,80	-0,77	-280.253	-4.492
Subtotal BONOS 2023	1.042.346	0,79	-1.048.597	-0,80	-0,77	-230.083	-2.685
%Variación	10,43	15,51	-3,59	0,85	0,59	21,81	-67,29
PAGARES							
Subtotal PAGARÉS 2024	0	0,00	0	0,00	0,00	0	0
Subtotal PAGARÉS 2023	0	0,00	0	0,00	0,00	0	0
%Variación	-	-	-	-	-	-	-
PRIVADOS							
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE TITULIZACION	3.220	3,67	-3.792	-4,32	-1,58	-2.500	0
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	2.167	18,25	-1.948	-16,40	-15,70	-219	0
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	1.422	0,71	-1.422	-0,71	-0,53	0	0
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	0	0,00	0	0,00	0,00	0	0
BBVA VELA CORPORATE 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	-207	-0,10	-22	-0,01	-0,01	0	0
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACIÓN	93	0,12	-252	-0,32	-0,19	2.480	0
CASA V, FONDO DE TITULIZACION	24	0,06	-213	-0,54	-0,20	0	0
CASA VI, FONDO DE TITULIZACION	9.988	2,26	-2.871	-0,65	-0,42	-35.066	0
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE TITULIZACION	1.046	0,81	-1.056	-0,82	-0,77	0	10
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0,00	0	0,00	0,00	0	0
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACIÓN	380	0,83	-380	-0,83	-0,74	0	0
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	122	6,41	-356	-18,66	-14,16	0	0
DACE, FONDO DE TITULIZACION	2.327	10,28	-3.840	-16,97	-15,46	0	0
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	382	1,13	-732	-2,16	-2,02	0	0
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACIÓN	15.099	36,28	-14.895	-35,79	-35,75	0	0
ENERGYA VM, FONDO DE TITULIZACION	13	6,52	-96	-46,83	-39,30	0	0
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	-65.011	-5,47	-4.732	-0,40	-0,03	0	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 10	-37	-0,04	-1.247	-1,23	-0,22	0	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 11	-66	-0,03	-1.081	-0,46	-0,03	0	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	-3.539	-2,03	-929	-0,53	-0,51	0	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	-1.862	-1,82	-482	-0,47	-0,43	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	-15	-0,28	-143	-2,71	-2,07	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	-119	-0,76	-143	-0,92	-0,69	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	-53	-0,06	-198	-0,24	-0,19	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	-139	-0,32	-178	-0,41	-0,35	0	0
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	2.646	5,20	-326	-0,64	-0,54	0	0
FONDO DE TITULIZACION TAYRONA	-64	-0,03	-1.063	-0,46	-0,02	0	0
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	0	0,00	-149	-1,15	-0,02	0	0
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	-3.459	-0,63	-148	-0,03	-0,02	29.181	0

Miles de euros

FONDO	MARGEN DE INTERESES		GASTOS DE EXPLOTACIÓN			DETERIORO	RTDO ACTIVOS NC EN VENTA (4)
	IMPORTE	% / TA (1)	IMPORTE	% / TA (2)	% COMISIONES (3)		
FTA2015, FTA	-301.786	-92,25	-11.047	-3,38	-2,38	-11.166	0
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	1.639	4,28	-2.345	-6,12	-5,97	-1.745	0
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	857	10,18	-857	-10,18	-9,32	0	0
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	2.506	9,34	-2.952	-11,00	-10,83	0	0
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	3.099	16,05	-3.849	-19,94	-19,76	750	0
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	315	0,71	-315	-0,71	-0,55	0	0
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	2.126	2,35	-2.126	-2,35	-2,26	0	0
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	-175	-2,08	-1.062	-12,64	-6,67	-3.562	0
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	964	0,30	-964	-0,30	-0,29	0	0
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	108	0,46	-108	-0,46	-0,45	0	0
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	985	4,55	-985	-4,55	-4,34	0	0
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE TITULIZACION	6.113	38,88	-5.784	-36,79	-36,06	0	0
MICROWD, FONDO DE TITULIZACION	199	9,96	-380	-19,04	-14,37	0	0
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	178	0,14	-178	-0,14	-0,05	0	0
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	2.611	17,26	-2.862	-18,92	-16,64	-96	0
OAK TRADE FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	389	2,28	-240	-1,41	-1,04	0	0
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	6.548	11,88	-1.968	-3,57	-2,31	0	0
PENSUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	2	0,03	-45	-0,84	-0,52	0	0
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	534	2,07	-597	-2,31	-2,08	-620	0
RONDA FUNDING, FONDO DE TITULIZACION	5	0,13	-272	-6,91	-2,31	0	0
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	11.944	7,11	-11.944	-7,11	-7,08	0	0
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	16.929	11,35	-4.820	-3,23	-2,01	-13.660	0
SLF, FONDO DE TITULIZACION	6.987	10,32	-1.831	-2,70	-2,13	-3.913	0
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	45	0,08	-157	-0,29	-0,20	2.205	0
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	188	0,03	-188	-0,03	-0,02	0	0
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	499	1,11	-298	-0,66	-0,60	370	0
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	311	0,52	-446	-0,75	-0,28	0	0
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	-1	-0,01	-69	-0,76	-0,62	-3.020	0
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	7.055	7,79	-2.405	-2,66	-1,63	422	0
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	17.953	14,07	-6.044	-4,74	-3,65	-5.044	0
TER 1, FONDO DE TITULIZACION	121	0,07	-620	-0,34	-0,20	0	0
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	995	1,02	-995	-1,02	-1,00	0	0
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE TITULIZACION	9.508	5,28	-9.460	-5,25	-5,21	-47	0
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	52.428	25,53	-14.936	-7,27	-5,26	971	0
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	413	2,49	-598	-3,61	-2,82	-761	0
WORKCAPITAL I, FONDO DE TITULIZACION	13.653	86,21	-13.103	-82,74	-81,45	-15	0
Subtotal PRIVADOS 2024	-169.395	-2,26	-149.541	-1,99	-1,62	-45.055	10
Subtotal PRIVADOS 2023	-136.279	-2,25	-157.721	-2,61	-1,56	24.674	-88
%Variación	-24,30	-0,28	-5,19	-23,51	3,49	-	-
Total 2024	981.622	0,74	-1.160.462	-0,87	-0,82	-325.309	-4.482
Total 2023	906.067	0,66	-1.206.318	-0,88	-0,80	-205.409	-2.773
%Variación	8,34	11,87	-3,80	-0,66	2,13	58,37	-61,62

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

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

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

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

Miles de euros

FONDO	% VARIACIÓN MI (1)	INT ACTIVOS TITULIZADOS	INT OBLIGACIONES	OTROS INTERESES	TIPO INT DCHOS CREDITO (2)	TIPO INTERÉS OBLIGACIONES (3)
BONOS						
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	67,87	4.863	-4.937	409	7,27	0,92
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-51,05	10.037	-5.035	557	9,84	4,19
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	-42,72	24.033	-18.063	861	7,16	4,77
AUTO ABS SPANISH LOANS 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	-	12.849	-6.838	166	7,75	4,30
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	-54,79	12.225	-7.951	601	8,01	4,58
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	-37,78	30.104	-18.514	1.113	7,16	4,46
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	-27,01	29.467	-22.683	654	7,44	5,37
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	113,27	39.176	-26.992	601	7,59	4,92
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	96,67	5.777	-5.747	-86	4,19	3,98
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	-30,95	2.246	-2.149	-438	4,79	3,92
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	-40,16	73.591	-73.509	0	4,76	4,75
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	117,18	75.179	-75.104	83	3,75	3,75
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	28,73	35.636	-15.531	-4.975	4,27	1,84
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	-78,80	5.509	-5.329	22	4,10	3,89
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	-52,97	5.399	-5.189	122	4,12	3,64
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	0,00	7.865	-7.566	9	4,15	3,78
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	-440,65	6.351	-6.160	-553	4,15	3,71
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	-62,96	7.645	-7.566	-2.112	4,06	3,81
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	-51,06	5.785	-5.745	-1.515	4,16	3,83
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	-93,40	39.953	-41.104	-4.664	4,14	4,04
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	-161,97	12.905	-13.215	-1.626	4,21	4,31
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	-67,88	14.079	-14.425	-1.824	4,23	4,31
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	0,00	5.080	-5.089	-438	4,35	4,25
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	0,00	6.369	-6.292	2	4,29	4,19
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	-17,85	0	-277	-26	0,00	0,00
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	-0,62	3.149	-2.711	-215	4,45	3,79
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	-51,88	1.511	-1.549	5	4,25	4,25
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	0,00	4.660	-4.320	-297	4,21	3,87
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	-72,33	10.463	-9.122	-626	4,46	3,90
BANCAJA 10, FTA	-94,75	20.779	-20.958	641	4,55	4,29
BANCAJA 11, FTA	0,00	19.580	-19.646	111	4,50	4,31
BANCAJA 13, FTA	-119,56	42.282	-40.168	-9.556	4,58	4,23
BANCAJA 9, FTA	-41,43	10.271	-12.168	1.001	4,68	4,52
BANKINTER 11, FTH	-143,10	3.841	-4.264	263	4,25	4,24
BANKINTER 13 FTA	-28,52	8.921	-9.281	559	4,29	4,11
BBVA CONSUMER 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	-	35.173	-23.617	721	7,79	4,93
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	-53,80	5.815	-1.976	-32	6,98	2,13
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-37,29	26.695	-22.866	1.336	6,54	5,13
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACIÓN	-29,38	39.612	-34.174	1.577	6,18	4,95
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	35,52	41.982	-34.206	1.262	6,61	5,07
BBVA CONSUMER AUTO 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	-	22.889	-12.097	292	8,04	4,19
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	-44,27	29.573	-5.747	-15	6,91	1,24
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	-35,64	46.468	-871	-718	7,06	0,13
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	-10,26	113.383	-44.395	-1.399	5,65	2,07
BBVA CONSUMO 13, FONDO DE TITULIZACION	-	100.327	-30.557	-786	7,06	2,05
BBVA LEASING 1, FTA	-12,33	263	-1.604	-2.833	4,05	4,52
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	147,64	56.359	-39.819	1.154	3,24	2,09
BBVA RMBS 1, FTA	-38,26	21.022	-19.521	-986	4,43	3,98
BBVA RMBS 14, FTA	55,70	9.343	-10.947	-4	3,58	4,05
BBVA RMBS 2, FTA	12,86	39.549	-36.423	14	4,44	3,95
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	2,49	48.990	-73.083	798	2,66	3,86
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	-16,39	384.293	-377.190	6.775	4,08	3,87
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	-10,21	24.160	-49.188	462	1,95	3,86
BBVA RMBS 23, FONDO DE TITULIZACION	-	104.176	-107.892	1.180	3,62	3,70
BBVA RMBS 3, FTA	0,00	37.039	-39.324	-1.914	4,43	4,06
BBVA-6 FTPYME FTA	39,63	926	-529	-1.464	0,00	4,38
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	-93,33	3.719	-3.534	39	4,31	3,83
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	-87,15	1.216	-1.489	-458	4,55	5,42
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	0,00	556	-605	-46	4,51	4,46
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	-61,81	21.438	-3.542	-1.156	6,59	1,00
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	68,20	127.445	-83.452	-6.387	6,88	4,24
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	-14,48	11.353	-2.344	-635	3,93	1,00
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	34,10	20.470	-24.623	3	4,23	4,34
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	-23,49	19.396	-4.314	-1.449	3,58	0,79
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	-25,41	23.765	-2.987	-2.112	3,34	0,43
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACIÓN	534,98	103.358	-69.109	7.765	3,90	2,54
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	81,73	297.937	-292.089	-19.720	4,34	3,38
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	29,85	54.091	-61.999	-4.287	3,70	3,74

Miles de euros

FONDO	% VARIACIÓN MI (1)	INT ACTIVOS TITULIZADOS	INT OBLIGACIONES	OTROS INTERESES	TIPO INT DCHOS CREDITO (2)	TIPO INTERÉS OBLIGACIONES (3)
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	58,79	53.031	-55.025	-1.875	4,13	3,38
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	83,75	2.511	-2.533	-136	4,20	4,04
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	6,29	90.647	-47.649	1.596	7,74	3,82
CEDULAS TDA 6, FTA	373,18	116.443	-116.443	338	3,88	3,88
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	-7,03	112.660	-23.558	-2.700	20,04	4,09
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	-8,36	44	-56	-748	5,22	6,23
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	-132,95	3.504	-5.317	1.111	4,30	4,64
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	-184,73	2.713	-4.223	801	4,27	4,47
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	-40,51	60	-2.082	-17	2,75	5,80
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	-57,81	10.876	-11.357	980	4,49	4,14
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	-306,93	21.949	-27.228	376	4,51	3,98
FTA UCI 14	0,00	7.380	-7.583	86	4,29	4,03
FTA UCI 16	0,00	13.237	-14.137	865	4,25	4,15
FTA, UCI 15	-82,59	9.778	-10.168	680	4,28	4,04
FTA, UCI 17	0,00	11.404	-12.251	688	4,28	4,14
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	-20,63	203.699	-113.936	-69.595	2,49	2,98
FTH UCI 12	0,00	4.505	-4.338	38	4,40	4,03
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	-30,28	33.617	-39.560	8.252	4,79	4,22
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	-4,96	12.268	-15.202	521	2,68	4,50
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	29,73	12.325	-12.688	1.060	2,67	3,06
FONDO DE TITULIZACIÓN RMBS PRADO X	-2,07	15.214	-19.659	719	2,67	3,59
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	-29,06	20.504	-14.971	1.245	6,45	4,45
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	1,12	12.409	-16.614	1.541	2,51	4,29
FTPYME TDA CAM 4, FTA	-20,21	1.377	-3.638	960	4,61	5,93
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	-7,32	393	-1.310	214	3,42	6,50
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	-19,92	129	-782	-677	5,13	2,35
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	-13,30	4.586	-5.635	102	4,75	4,04
HIPOCAT 10, FTA	-27,28	6.024	-9.857	118	4,66	4,77
HIPOCAT 11, FTA	-28,09	6.732	-13.008	114	4,62	4,51
HIPOCAT 9, FTA	-223,40	4.113	-4.921	380	4,70	4,62
IM ANDBANK RMBS 1,FONDO DE TITULIZACION	0,00	3.722	-3.532	322	4,64	3,82
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	62,48	15.547	-11.991	935	5,20	3,84
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	7,12	19.858	-192	792	4,80	0,04
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACIÓN	13,17	18.322	-13.486	1.459	5,76	3,87
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	-73,37	21.483	-18.330	1.397	5,02	3,85
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	-8,89	7.308	-1.389	661	5,74	0,97
IM BCG RMBS 2, FTA	-73,30	17.199	-13.965	-2.809	4,50	4,06
IM CAJAMAR 3, FTA	-67,40	4.814	-4.790	478	4,57	3,92
IM CAJAMAR 4, FTA	-64,34	5.965	-5.718	370	4,61	4,05
IM CAJAMAR 5, FTA	0,00	6.081	-6.103	407	4,57	4,15
IM CAJAMAR 6, FTA	0,00	15.444	-16.470	1.224	4,51	4,29
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	-0,38	7.375	-6.681	-1.941	4,44	4,02
IM PASTOR 2, FTH	0,00	1.316	-1.410	-1	4,34	4,91
IM PASTOR 3, FTH	0,04	2.726	-3.920	-519	4,44	3,97
IM PASTOR 4, FTA	30,96	3.824	-4.421	-265	4,35	4,02
MADRID RMBS I, FTA	0,00	15.595	-13.971	-2.878	4,66	4,02
MADRID RMBS II, FTA	-119,87	13.606	-12.261	-3.058	4,64	4,05
MADRID RMBS III FTA	-37,78	28.503	-27.390	-6.663	4,39	4,12
MBS BANCAJA 4, FTA	-34,69	8.856	-9.078	1.068	4,80	4,38
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	2,76	57.338	-30.005	1.423	8,12	3,53
PEPPER IBERIA CONSUMER 2024, FONDO DE TITULIZACION	-	14.856	-2.432	60	14,24	0,00
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	-82,18	35.458	-478	-21.887	3,20	0,05
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	-6,94	217.824	-217.824	26	4,25	4,25
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACION	40,68	16.659	-18.498	193	2,62	4,19
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	17.726	-18.275	-60	5,26	5,16
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	0,00	122.257	-121.990	0	4,34	4,02
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	0,00	168.982	-159.415	-35	4,48	3,95
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	-37,24	8.631	-8.329	507	4,55	4,09
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	-21,93	4.785	-4.628	348	4,66	4,11
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	0,00	2.643	-2.457	-105	4,55	4,07
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	283,17	12.072	-10.610	63	5,01	4,19
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	0,00	7.580	-7.007	-207	4,58	4,08
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	0,00	1.750	-1.629	-83	4,57	4,10
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	60,45	1.196	-757	-632	4,83	5,23
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	214,87	6.453	-5.570	-36	5,08	4,21
RURAL HIPOTECARIO XX, FONDO DE TITULIZACION	-	20.144	-17.389	144	4,73	3,92
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE TITULIZACION	43,21	33.754	-26.564	2.118	7,14	3,75
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	-49,58	4.239	-4.188	383	6,67	5,15
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	-36,49	24.071	-23.072	579	6,93	6,33
SABADELL CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	-	18.861	-9.072	331	9,13	4,33

Miles de euros

FONDO	% VARIACIÓN MI (1)	INT ACTIVOS TITULIZADOS	INT OBLIGACIONES	OTROS INTERESES	TIPO INT DCHOS CREDITO (2)	TIPO INTERÉS OBLIGACIONES (3)
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	-44,21	12.619	-7.134	0	7,81	4,02
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-33,48	8.482	-6.009	576	6,82	4,53
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	-12,98	39.621	-32.381	-25	6,77	5,27
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	357,42	47.634	-31.203	1.199	8,13	5,11
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	-	14.865	-6.701	128	8,74	4,10
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	-32,92	29.851	-21.553	962	6,83	4,45
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	66,09	37.008	-33.823	1.832	6,64	5,52
SANTANDER CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	-	45.226	-36.173	1.386	6,69	4,94
SANTANDER CONSUMO 7, FONDO DE TITULIZACION	-	10.785	-6.511	154	6,73	4,02
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	259,65	576.388	-677.653	-4.662	3,62	3,40
TDA 19 - MIXTO, FTA	2,80	1.137	-1.300	-149	4,53	4,85
TDA 22 - MIXTO, FTA	15,57	1.630	-1.939	-96	4,54	4,79
TDA 24, FTA	0,00	6.556	-2.671	55	4,75	4,09
TDA 25, FTA	0,00	8.140	-3.689	65	0,00	3,97
TDA 26 - MIXTO, FTA	-63,65	2.949	-3.095	361	4,52	4,17
TDA 27, FTA	-10,11	5.440	-6.971	-461	4,59	4,04
TDA 28, FTA	-21,47	3.869	-8.177	-55	4,68	4,04
TDA 29, FTA	-45,92	5.239	-5.138	310	4,46	4,01
TDA 30, FTA	-47,50	3.724	-3.822	271	4,44	4,15
TDA CAJAMAR 2, FTA	-36,06	3.153	-2.889	371	4,57	3,91
TDA CAM 4, FTA	-58,44	2.929	-2.716	6	4,40	3,85
TDA CAM 5, FTA	-45,02	8.865	-7.991	258	4,47	3,84
TDA CAM 6, FTA	-48,37	6.168	-5.653	47	4,40	3,83
TDA CAM 7, FTA	-36,21	10.362	-9.304	273	4,49	3,87
TDA CAM 8, FTA	-52,10	9.164	-8.721	527	4,51	3,97
TDA CAM 9, FTA	-71,20	9.789	-10.100	522	4,50	4,16
TDA IBERCAJA 4, FTA	-66,83	7.181	-7.160	505	4,42	4,00
TDA IBERCAJA 5, FTA	0,00	7.711	-7.611	463	4,38	3,96
TDA IBERCAJA 6, FTA	-90,40	12.937	-12.652	124	4,34	4,05
TDA IBERCAJA 7, FTA	-90,04	24.220	-26.500	1.942	4,22	4,12
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	-37,90	129.033	-139.259	6.088	4,11	4,19
TDA TARRAGONA 1, FTA	0,00	2.049	-2.586	330	4,43	4,57
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	-45,83	4.146	-4.018	5	4,56	4,08
Subtotal BONOS 2024	10,43	5.378.192	-4.665.427	-109.736	4,56	3,69
Subtotal BONOS 2023	-30,36	4.748.605	-4.215.106	-64.554	4,14	3,51
%Variación	-	13,26	10,68	-69,99	10,21	5,09
PAGARÉS						
Subtotal PAGARÉS 2024	0,00	0	0	0	0,00	0,00
Subtotal PAGARÉS 2023	0,00	0	0	0	0,00	0,00
%Variación	-	-	-	-	-	-
PRIVADOS						
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE TITULIZACION	-	4.746	0	-1.526	7,06	0,00
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	36,27	3.067	-901	0	8,67	6,85
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	45,34	5.027	-3.610	5	3,72	2,45
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	-	614	-614	0	4,73	4,73
BBVA VELA CORPORATE 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	-	0	-2.264	2.057	0,00	9,41
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACION	-91,82	3.453	-3.368	8	0,00	0,00
CASA V, FONDO DE TITULIZACION	-	931	-917	10	7,67	0,00
CASA VI, FONDO DE TITULIZACION	-	48.459	-38.675	203	4,75	0,00
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE TITULIZACION	110,94	4.501	-4.539	1.084	0,98	3,77
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACION	-	799	-1.928	0	0,00	5,42
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACION	81,11	2.955	-2.576	0	7,93	6,54
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACION	-93,70	520	-397	0	6,92	5,85
DACE, FONDO DE TITULIZACION	-	3.369	-1.016	-26	1,73	2,82
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	44,65	868	-486	0	3,44	1,93
ELEC NOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACION	-19,21	15.484	-529	144	0,00	2,00
ENERGYA VM, FONDO DE TITULIZACION	-	15	-2	0	7,74	0,00
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	-97,25	0	-67.622	713	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 10	-	0	-5.564	5.527	0,00	11,84
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 11	-	0	-1.457	1.391	0,00	9,50
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	-42,64	0	-23.871	20.332	0,00	14,41
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	0,00	0	-14.850	12.988	0,00	13,78
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	75,41	0	-898	883	0,00	14,17

Miles de euros

FONDO	% VARIACIÓN MI (1)	INT ACTIVOS TITULIZADOS	INT OBLIGACIONES	OTROS INTERESES	TIPO INT DCHOS CREDITO (2)	TIPO INTERÉS OBLIGACIONES (3)
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	0,00	0	-2.070	1.951	0,00	12,71
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	90,62	0	-5.132	5.079	0,00	8,69
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	45,06	0	-3.826	3.687	0,00	8,51
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	0,00	0	-7.978	10.624	0,00	12,24
FONDO DE TITULIZACION TAYRONA	-	0	-1.401	1.337	0,00	0,00
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	-	569	-569	0	0,00	4,74
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	-2.285,52	19.639	-24.231	1.133	5,10	0,00
FTA2015, FTA	-19,02	25.179	-326.892	-73	1,74	0,00
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	25,67	7.821	-252	-5.930	0,00	0,00
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	-34,99	1.312	-585	130	2,14	6,12
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	-28,10	3.002	-856	361	11,32	0,00
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	15,54	3.756	-658	0	3,78	2,00
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	-51,77	2.686	-2.452	81	5,12	4,81
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	-39,54	4.264	-3.556	1.418	0,63	4,34
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	-38,13	993	-1.167	0	4,94	6,37
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	8,44	10.086	-9.122	0	3,04	2,86
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	-7,18	643	-535	0	2,71	2,19
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	-3,49	1.735	-944	194	1,49	4,32
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE TITULIZACION	74,25	6.708	-803	208	0,00	0,00
MICROWD, FONDO DE TITULIZACION	-	285	-86	0	19,93	7,74
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	-16,88	5.205	-4.670	-357	4,59	0,00
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	146,82	3.479	-869	0	0,00	8,40
OAK TRADE FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	-	675	-382	96	0,00	6,26
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	331,04	9.035	-1.587	-900	7,04	0,00
PENSUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	-	5	-3	0	6,96	4,75
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	62,90	1.717	-1.294	14	7,37	17,78
RONDA FUNDING, FONDO DE TITULIZACION	-	19	0	-14	3,55	0,00
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	42,79	14.578	-2.688	54	0,00	3,25
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	583,97	18.157	-1.371	143	0,00	0,00
SLF, FONDO DE TITULIZACION	-1,39	13.843	-6.800	-56	4,62	0,00
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	-99,03	5.655	-5.602	-8	2,95	0,00
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	-40,31	57.609	-57.417	-4	6,88	0,00
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	0,00	32.720	-32.258	37	0,00	0,00
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	-84,11	21.195	-20.884	0	0,00	0,00
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	-1.310,81	0	0	-1	0,00	0,00
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	28,02	8.239	-1.278	94	0,00	0,00
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	-6,41	21.640	-3.808	122	0,00	0,00
TER 1, FONDO DE TITULIZACION	-	0	-10.618	10.739	0,00	11,19
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	-76,28	5.709	-5.704	989	4,21	0,00
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE TITULIZACION	71,16	17.509	-8.249	247	11,86	5,18
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	5,66	52.362	0	66	4,76	0,00
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	-18,05	1.525	-1.112	0	11,28	4,40
WORKCAPITAL I, FONDO DE TITULIZACION	-	14.376	0	-722	0,00	0,00
Subtotal PRIVADOS 2024	-24,30	488.737	-735.792	74.534	3,51	1,10
Subtotal PRIVADOS 2023	-24,36	501.078	-707.065	68.538	3,12	1,61
%Variación	0,25	-2,46	4,06	8,75	12,42	-31,68
Total 2024	8,34	5.866.929	-5.401.218	-35.202	4,52	3,58
Total 2023	-34,13	5.249.683	-4.922.171	3.984	4,10	3,44
%Variación	-	11,76	9,73	-	10,21	4,10

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

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

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

Miles de euros

FONDO	COMISIÓN VARIABLE				
	COMISIÓN GESTORA DEVENGADA EN EL PERIODO	IMPORTE DEVENGADO EN EL PERIODO	IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR (1)	CORRECCIONES DE VALOR POR REPERCUSIÓN DE PÉRDIDAS (1)	OTRAS COMISIONES DEVENGADAS EN EL PERIODO
BONOS					
ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACTION TWENTY, FONDO DE TITULIZACIÓN	-77	0	0	0	-123
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-117	-9.373	0	0	-173
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	-110	-15.193	0	0	-488
AUTO ABS SPANISH LOANS 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	-121	0	0	0	-194
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	-77	-14.518	0	0	-646
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	-94	-31.345	7.665	0	-708
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	-92	-13.787	10.076	0	-670
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	-97	-12.328	7.075	0	-849
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	-13	0	6	-63	-90
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	-21	0	634	-772	-16
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	0	0	1	-1	0
AYT CEDULAS CAJAS X, FTA	0	-67	1.605	0	0
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FTA	-139	0	3.438	-3.901	-138
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	-46	0	983	-1.031	-31
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	-45	0	1.085	-715	-37
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	-44	0	1.638	-1.934	-39
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	-57	0	2.101	-2.935	-35
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	-56	0	447	-1.498	-23
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	-56	0	0	0	-34
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	-213	0	1.462	-1.462	-119
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	-66	0	0	0	-38
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	-84	0	0	0	-41
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	-45	-23	276	0	-12
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	-44	-141	969	-567	-15
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	-38	0	2.391	-2.509	0
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	-44	-403	0	-91	-16
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	-18	0	334	-473	-4
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	-44	0	825	-307	-21
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	-47	-1.164	876	0	-34
BANCAJA 10, FTA	-106	0	25.028	-27.004	-55
BANCAJA 11, FTA	-80	0	11.510	-13.164	-52
BANCAJA 13, FTA	-137	0	24.378	-26.890	-97
BANCAJA 9, FTA	-79	0	18.207	-19.361	-28
BANKINTER 11, FTH	-54	0	2.324	-2.605	-18
BANKINTER 13 FTA	-54	0	6.517	-2.697	-30
BBVA CONSUMER 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	-94	-12.834	6.898	0	-79
BBVA CONSUMER AUTO 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	-80	-3.731	1.000	0	-57
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-115	-16.875	5.597	0	-91
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACION	-135	-16.122	5.783	0	-114
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	-128	-5.246	4.106	0	-113
BBVA CONSUMER AUTO 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	-54	-13.531	10.083	0	-43
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	-116	-16.573	873	0	-95
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	-140	-33.847	5.286	0	-118
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	-244	-38.111	16.468	0	-270
BBVA CONSUMO 13, FONDO DE TITULIZACION	-205	-53.579	17.916	0	-188
BBVA LEASING 1, FTA	-43	0	0	0	-20
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	-254	-10.102	4.030	0	-233
BBVA RMBS 1, FTA	-80	0	15.150	-12.460	-59
BBVA RMBS 14, FTA	-47	0	832	-897	-74
BBVA RMBS 2, FTA	-146	0	29.605	-1.276	-102
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	-249	-20.907	7.877	0	-234
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	-358	-59.796	27.469	0	-1.003
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	-193	-7.700	3.640	0	-173
BBVA RMBS 23, FONDO DE TITULIZACION	-177	-18.969	2.826	0	-317

Miles de euros

FONDO	COMISIÓN VARIABLE				
	COMISIÓN GESTORA DEVENGADA EN EL PERIODO	IMPORTE DEVENGADO EN EL PERIODO	IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR (1)	CORRECCIONES DE VALOR POR REPERCUSIÓN DE PÉRDIDAS (1)	OTRAS COMISIONES DEVENGADAS EN EL PERIODO
BBVA RMBS 3, FTA	-145	0	20.314	-20.315	-97
BBVA-6 FTPYME FTA	-42	0	0	0	-11
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	-75	-859	0	0	-9
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	-48	-718	0	0	-9
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	-50	-96	0	0	-9
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	-123	-11.876	1.719	0	-49
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	-543	0	0	-138	-198
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	-116	-8.673	951	0	-41
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	-126	0	0	-87	-65
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	-138	-12.971	3.186	0	-70
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	-188	-15.819	1.102	0	-87
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACION	-681	-30.138	10.917	0	-263
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	-686	0	0	-1.660	-683
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	-329	0	0	-337	-162
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	-290	0	0	-297	-145
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	-64	0	0	0	-15
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	-126	-31.109	12.427	0	-12.323
CEDULAS TDA 6, FTA	0	0	0	0	0
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	-105	-85.547	0	0	-88
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	-21	0	164	-227	-13
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	-60	0	1.093	-2.341	-39
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	-54	0	158	-1.097	-34
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	-70	0	17.631	-18.032	-24
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	-70	0	10.439	-10.846	-24
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	-129	0	0	-407	-24
FTA UCI 14	-48	-2.182	15.220	0	-24
FTA UCI 16	-68	-5.690	26.489	0	-24
FTA, UCI 15	-50	-3.915	17.061	0	-24
FTA, UCI 17	-60	-5.540	21.673	0	-24
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	-37	0	0	0	-220
FTH UCI 12	-48	-525	3.023	0	-24
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	-229	0	0	-47	-50
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	-67	-4.744	0	-1	-37
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	-69	-409	0	-1	-36
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO X	-81	-4.206	0	-1	-37
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	-99	-18.226	0	0	-429
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	-77	-5.703	0	-1	-37
FTPYME TDA CAM 4, FTA	-27	0	0	0	-9
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	-36	0	430	-429	-10
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	-24	0	0	-190	-10
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	-32	0	2.521	-4.780	-81
HIPOCAT 10, FTA	-56	0	6.631	-6.632	-10
HIPOCAT 11, FTA	-78	0	8.613	-8.613	-10
HIPOCAT 9, FTA	-50	0	3.144	-3.144	-10
IM ANDBANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	-81	-314	133	-133	-28
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	-64	-4.363	24.284	0	-43
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	-69	-20.288	16.953	0	-77
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACION	-65	-6.400	32.034	0	-64
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	-72	-4.973	30.771	0	-83
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	-55	-6.115	14.083	0	-35
IM BCG RMBS 2, FTA	-71	-177	0	0	-62
IM CAJAMAR 3, FTA	-64	-332	579	-420	-15
IM CAJAMAR 4, FTA	-58	-235	1.546	-44	-16
IM CAJAMAR 5, FTA	-50	-269	2.684	-682	-19

Miles de euros

FONDO	COMISIÓN VARIABLE				
	COMISIÓN GESTORA DEVENGADA EN EL PERIODO	IMPORTE DEVENGADO EN EL PERIODO	IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR (1)	CORRECCIONES DE VALOR POR REPERCUSIÓN DE PÉRDIDAS (1)	OTRAS COMISIONES DEVENGADAS EN EL PERIODO
IM CAJAMAR 6, FTA	-69	-54	6.906	-3.094	-30
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	-75	0	5.707	-3.491	-34
IM PASTOR 2, FTH	-7	-57	3.217	-234	-9
IM PASTOR 3, FTH	-27	0	27.537	-27.537	-22
IM PASTOR 4, FTA	-28	0	10.364	-10.364	-26
MADRID RMBS I, FTA	-103	0	0	0	-20
MADRID RMBS II, FTA	-95	0	0	0	-18
MADRID RMBS III FTA	-143	0	0	0	-40
MBS BANCAJA 4, FTA	-50	0	26.936	-2.140	-24
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	-70	-19.420	0	0	-99
PEPPER IBERIA CONSUMER 2024, FONDO DE TITULIZACION	-22	-10.695	5.885	0	-150
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	-78	-4.306	0	0	-10.593
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	0	0	0	0	0
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACION	-80	0	0	-37	-33
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	-86	0	0	0	-1.572
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	-769	0	23.332	-23.419	-49
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	-1.024	0	1.540	-1.621	-33
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	-60	-811	4.878	0	-26
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	-55	-443	2.244	0	-17
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	-26	0	528	-544	-12
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	-93	-1.324	2.295	0	-31
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	-35	0	1.016	-948	-23
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	-22	0	352	-361	-10
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	-23	0	142	-174	-8
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	-71	-695	934	0	-19
RURAL HIPOTECARIO XX, FONDO DE TITULIZACION	-78	-2.079	0	0	-46
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE TITULIZACION	-75	-3.564	0	0	-341
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	-72	0	0	0	-19
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	-137	0	9.263	-3.257	-120
SABADELL CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	-32	-11.610	4.803	0	-64
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	-102	-10.201	2.553	0	-272
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	-100	-6.810	2.973	0	-172
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	-152	-18.237	11.274	0	-769
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACIÓN	-152	-13.181	10.742	0	-762
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	-44	0	0	0	-206
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	-121	-27.084	5.632	0	-43
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	-152	0	0	-31	-33
SANTANDER CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	-181	0	0	-13	-18
SANTANDER CONSUMO 7, FONDO DE TITULIZACION	-42	0	0	-2	-3
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	-88	-48.238	0	0	-309
TDA 19 - MIXTO, FTA	-71	0	0	0	0
TDA 22 - MIXTO, FTA	-125	0	0	0	0
TDA 24, FTA	-143	0	0	0	-13
TDA 25, FTA	-57	0	0	0	-13
TDA 26 - MIXTO, FTA	-86	-491	0	0	-26
TDA 27, FTA	-61	0	0	0	-16
TDA 28, FTA	-32	0	0	0	-60
TDA 29, FTA	-82	-542	0	0	-16
TDA 30, FTA	-43	-474	0	0	-15
TDA CAJAMAR 2, FTA	-41	-756	0	0	-14
TDA CAM 4, FTA	-60	-1.341	0	0	-9
TDA CAM 5, FTA	-92	-1.640	0	0	-9
TDA CAM 6, FTA	-75	0	0	0	-9
TDA CAM 7, FTA	-84	-2.257	0	0	-9

Miles de euros

COMISIÓN VARIABLE

	COMISIÓN GESTORA DEVENGADA EN EL PERIODO	IMPORTE DEVENGADO EN EL PERIODO	IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR (1)	CORRECCIONES DE VALOR POR REPERCUSIÓN DE PÉRDIDAS (1)	OTRAS COMISIONES DEVENGADAS EN EL PERIODO
FONDO					
TDA CAM 8, FTA	-70	-1.630	0	0	-9
TDA CAM 9, FTA	-88	0	0	0	-9
TDA IBERCAJA 4, FTA	-68	-739	0	0	-30
TDA IBERCAJA 5, FTA	-67	-857	0	0	-31
TDA IBERCAJA 6, FTA	-64	-1.605	0	0	-37
TDA IBERCAJA 7, FTA	-88	-2.738	0	0	-13
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	-192	0	0	0	-323
TDA TARRAGONA 1, FTA	-43	0	0	0	-10
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	-43	-15	5.255	-22	-15
Subtotal BONOS 2024	-17.851	-912.574	781.573	-282.806	-41.046
Subtotal BONOS 2023	-16.840	-948.565	771.866	-282.658	-44.884
%Variación	6,00	-3,79	1,26	0,05	-8,55
PAGARES					
Subtotal PAGARÉS 2024	0	0	0	0	0
Subtotal PAGARÉS 2023	0	0	0	0	0
%Variación	-	-	-	-	-
PRIVADOS					
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE TITULIZACION	-50	-1.144	1.144	0	-195
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	-78	-1.763	3	0	-23
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	-198	-746	660	0	-108
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	0	0	0	0	0
BBVA VELA CORPORATE 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	-21	0	0	0	-1
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACION	-84	0	0	0	-60
CASA V, FONDO DE TITULIZACION	-11	0	0	0	-68
CASA VI, FONDO DE TITULIZACION	-171	0	0	0	-1.668
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE TITULIZACION	-120	-673	0	0	-199
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACION	-88	0	0	0	-251
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACION	-73	-181	168	0	-15
DACE, FONDO DE TITULIZACION	-101	-3.284	1.914	-41	-115
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	-77	-392	485	-220	-213
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACION	-44	-14.822	0	0	-15
ENERGYA VM, FONDO DE TITULIZACION	-81	0	0	0	0
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	-270	0	0	0	-43
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 10	-217	0	0	0	-4
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 11	-71	0	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	-876	0	5.967	0	-8
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	-428	0	1.833	0	-8
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	-100	0	192	-192	-9
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	-99	0	149	-149	-9
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	-138	0	40	-40	-17
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	-137	0	383	-383	-16
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	-266	0	1.262	-1.262	-8
FONDO DE TITULIZACION TAYRONA	-54	0	0	0	0
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	-2	0	20	-9	0
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	-104	0	0	0	-8
FTA2015, FTA	-388	0	0	0	-7.386
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	-60	-850	1.731	0	-1.378
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	-47	-714	796	0	-24
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	-121	-2.747	0	0	-39
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	-85	-3.715	5.011	-885	-15
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	-88	0	90	-84	-157
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	-63	-1.850	623	0	-131
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	-121	0	0	0	-439

Miles de euros

FONDO	COMISIÓN VARIABLE				
	COMISIÓN GESTORA DEVENGADA EN EL PERIODO	IMPORTE DEVENGADO EN EL PERIODO	IMPORTE PENDIENTE DE LIQUIDAR (1)	CORRECCIONES DE VALOR POR REPERCUSIÓN DE PÉRDIDAS (1)	OTRAS COMISIONES DEVENGADAS EN EL PERIODO
IM MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	-114	0	0	0	-843
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACIÓN	-49	0	0	0	-57
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	-62	-809	286	0	-69
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE TITULIZACION	-85	-5.545	0	0	-39
MICROWD, FONDO DE TITULIZACION	-82	-200	31	0	-4
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	-51	0	0	0	-10
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACIÓN	-115	-1.480	1.103	0	-922
OAK TRADE FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	-119	0	0	0	-57
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	-60	-1.200	0	0	-15
PENSUM ESG I, FONDO DE TITULIZACIÓN	-24	0	0	0	-4
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	-78	0	0	0	-459
RONDA FUNDING, FONDO DE TITULIZACION	-86	0	0	0	-5
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	-62	-11.822	4.665	0	-13
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	-81	0	0	0	-2.913
SLF, FONDO DE TITULIZACION	-31	0	0	0	-1.413
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	-37	0	0	0	-72
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	-74	-81	234	0	0
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	-125	0	0	0	-147
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	-85	0	0	0	-83
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	-35	0	0	0	-22
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	-52	0	0	0	-1.428
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	-74	0	0	0	-4.580
TER 1, FONDO DE TITULIZACION	-237	-128	128	0	-7
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	-144	-799	812	0	-32
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE TITULIZACION	-107	-9.089	2.567	0	-192
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	-86	0	0	0	-10.720
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	-94	0	0	-172	-373
WORKCAPITAL I, FONDO DE TITULIZACION	-63	-12.826	0	0	-9
Subtotal PRIVADOS 2024	-7.245	-76.861	32.297	-3.438	-37.118
Subtotal PRIVADOS 2023	-5.945	-55.274	21.401	-2.063	-33.283
%Variación	21,87	39,05	50,92	66,64	11,52
Total 2024	-25.096	-989.435	813.870	-286.244	-78.164
Total 2023	-22.785	-1.003.839	793.267	-284.721	-78.167
%Variación	10,14	-1,43	2,60	0,53	0,00

(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	5.204	-4.930	0	0	66.098	-70.184	-200	-0,43
AUTO ABS SPANISH LOANS 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	10.594	-5.090	3.159	0	90.966	-96.084	-9.665	-12,44
AUTO ABS SPANISH LOANS 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	0	0	24.973	-18.226	9.788	0	187.574	-191.764	-15.795	-5,71
AUTO ABS SPANISH LOANS 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	-615.579	606.000	9.684	-6.676	1.661	0	25.091	0	-29	0,00
AUTONORIA SPAIN 2019, FONDO DE TITULIZACION	0	0	12.789	-7.958	6.827	0	97.979	-104.349	-15.316	-11,97
AUTONORIA SPAIN 2021, FONDO DE TITULIZACION	0	0	31.182	-20.321	18.077	0	200.075	-207.636	-28.362	-7,69
AUTONORIA SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	0	0	30.239	-22.655	6.744	0	138.592	-145.391	-10.741	-3,03
AUTONORIA SPAIN 2023, FONDO DE TITULIZACION	-33.908	0	39.772	-26.928	2.746	-38	145.148	-110.695	-12.451	-2,60
AYT CAJA INGENIEROS 2, FTA	0	0	5.632	-5.938	0	0	22.007	-23.350	-105	-0,07
AYT CAJAGRANADA HIPOTECARIO I, FTA	0	0	2.210	-1.521	2.043	-2.306	6.805	-7.882	-31	-0,07
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA	0	0	73.468	-73.388	0	0	0	0	-80	0,00
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	36.227	-16.182	5.456	-5.147	133.047	-134.405	-385	-0,04
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FTH	0	0	5.721	-5.753	6.010	-5.761	23.745	-24.632	-63	-0,05
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FTH	0	0	5.448	-5.312	5.527	-5.565	25.641	-26.274	-190	-0,15
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH	0	0	7.909	-7.995	8.122	-8.194	36.315	-38.786	-64	-0,03
AYT GENOVA HIPOTECARIO X, FTH	0	0	6.454	-6.292	6.417	-6.555	25.745	-26.438	-62	-0,04
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FTH	0	0	7.710	-7.966	-7.050	7.231	30.852	-32.836	-45	-0,02
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	0	0	5.824	-5.866	5.219	-5.346	24.176	-24.546	-75	-0,05
AYT GOYA HIPOTECARIO III, FTA	0	0	40.404	-41.785	37.013	-36.251	147.087	-147.074	-319	-0,03
AYT GOYA HIPOTECARIO IV, FTA	0	0	13.034	-14.594	12.951	-12.089	49.764	-54.406	-103	-0,03
AYT GOYA HIPOTECARIO V, FTA	0	0	14.252	-15.965	13.882	-12.761	55.255	-61.415	-116	-0,03
AYT HIPOTECARIO BBK I, FTA	0	0	5.148	-5.524	5.905	-5.214	19.933	-20.891	-125	-0,09
AYT HIPOTECARIO BBK II, FTA	0	0	6.438	-6.821	7.338	-6.533	25.821	-28.175	-257	-0,17
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FTA	0	0	0	0	0	0	0	0	-39	-22,55
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FTA	0	0	3.854	-2.771	2.961	-3.079	11.620	-11.845	-461	-0,70
AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA	0	0	1.535	-1.649	1.722	-1.581	4.802	-4.958	-40	-0,10
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FTA	0	0	4.741	-4.616	4.975	-4.740	17.920	-18.281	-199	-0,18
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FTA	0	0	10.621	-9.770	5.584	-6.032	33.443	-35.655	-366	-0,16
BANCAJA 10, FTA	0	0	21.119	-19.275	17.659	-17.793	68.229	-65.578	-115	-0,02
BANCAJA 11, FTA	0	0	19.782	-22.329	17.167	-16.743	57.849	-56.779	-89	-0,02
BANCAJA 13, FTA	0	0	42.538	-42.566	38.993	-36.849	114.098	-108.785	-146	-0,01
BANCAJA 9, FTA	0	0	10.470	-13.703	8.101	-8.418	40.095	-37.485	-84	-0,04
BANKINTER 11, FTH	0	0	3.904	-4.451	3.594	-3.530	17.841	-18.402	-61	-0,07
BANKINTER 13 FTA	0	0	9.068	-10.013	8.487	-8.217	42.197	-44.964	-640	-0,30
BBVA CONSUMER 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	-799.999	807.100	30.381	-16.961	12.229	-9.652	126.055	-85.989	-6.056	-0,83

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 2018-1 FONDO DE TITULIZACION	0	0	5.957	-2.019	0	0	51.658	-57.714	-5.012	-7,12
BBVA CONSUMER AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	27.375	-25.786	17.850	-614	194.728	-214.150	-20.436	-5,51
BBVA CONSUMER AUTO 2022-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	40.407	-36.540	32.605	-15.815	233.427	-247.185	-19.117	-3,33
BBVA CONSUMER AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	42.500	-34.968	25.729	-22.339	160.954	-167.982	-6.033	-1,06
BBVA CONSUMER AUTO 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	-999.992	1.005.000	18.394	-10.822	8.797	-6.143	49.836	-36.390	-3.529	-0,36
BBVA CONSUMO 10, FONDO DE TITULIZACION	0	0	30.066	-5.773	0	0	232.996	-243.197	-17.362	-5,45
BBVA CONSUMO 11, FONDO DE TITULIZACION	0	0	45.837	-869	0	0	326.379	-335.468	-37.356	-6,61
BBVA CONSUMO 12, FONDO DE TITULIZACION	0	0	116.254	-46.181	0	0	688.575	-730.942	-41.588	-2,18
BBVA CONSUMO 13, FONDO DE TITULIZACION	-1.999.999	2.000.000	89.854	-26.541	0	0	451.455	-406.843	-35.996	-2,10
BBVA LEASING 1, FTA	0	0	279	-1.682	88	-273	2.215	-474	-62	-3,51
BBVA LEASING 3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	58.266	-40.420	54.084	-57.624	899.137	-886.885	-11.855	-0,72
BBVA RMBS 1, FTA	0	0	21.489	-19.806	22.541	-21.490	78.463	-78.358	-141	-0,03
BBVA RMBS 14, FTA	0	0	9.280	-10.944	0	0	33.419	-33.558	-94	-0,03
BBVA RMBS 2, FTA	0	0	40.397	-36.935	42.093	-40.410	146.105	-144.325	-6.704	-0,76
BBVA RMBS 20, FONDO DE TITULIZACION	0	0	49.807	-76.371	94.493	-50.524	178.330	-184.114	-17.652	-0,87
BBVA RMBS 21, FONDO DE TITULIZACION	0	0	393.473	-391.694	448.916	-401.431	1.096.569	-1.148.391	-48.349	-0,50
BBVA RMBS 22, FONDO DE TITULIZACION	0	0	24.451	-52.066	59.976	-24.907	91.352	-91.840	-6.514	-0,46
BBVA RMBS 23, FONDO DE TITULIZACION	-5.449.992	5.450.001	88.606	-102.653	119.390	-87.809	250.503	-218.800	-16.578	-0,30
BBVA RMBS 3, FTA	0	0	37.926	-29.820	40.978	-38.637	113.083	-124.879	-246	-0,03
BBVA-6 FTPYME FTA	0	0	31	-579	30	-31	2.772	-1.671	-54	-6,72
CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA	0	0	3.748	-3.773	85	0	17.499	-18.399	-943	-1,01
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FTA	0	0	1.236	-1.534	0	0	7.297	-5.569	-775	-1,12
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA	0	0	567	-610	0	-13	4.118	-4.034	-155	-0,68
CAIXABANK CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	0	0	23.402	-4.118	0	0	285.554	-345.735	-14.135	-5,64
CAIXABANK CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	-366.281	0	128.541	-84.312	0	0	709.386	-378.824	-615	-0,04
CAIXABANK LEASINGS 3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	11.431	-2.373	0	0	78.302	-84.780	-9.016	-4,62
CAIXABANK PYMES 10, FONDO DE TITULIZACION	0	0	21.484	-27.110	0	0	165.220	-187.840	-153	-0,04
CAIXABANK PYMES 11, FONDO DE TITULIZACION	0	0	20.683	-4.651	0	0	215.634	-237.676	-14.385	-3,00
CAIXABANK PYMES 12, FONDO DE TITULIZACION	0	0	25.208	-3.013	0	0	346.710	-340.203	-16.461	-2,78
CAIXABANK PYMES 13, FONDO DE TITULIZACION	0	0	103.133	-66.167	0	0	744.126	-650.724	-25.148	-1,00
CAIXABANK RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	301.552	-322.192	0	0	911.005	-927.358	-708	-0,01
CAIXABANK RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION	0	0	54.673	-67.344	0	0	167.285	-172.190	-357	-0,02
CAIXABANK RMBS 3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	53.682	-57.940	0	0	167.064	-170.166	-312	-0,03
CAJA INGENIEROS TDA 1, FTA	0	0	2.525	-2.622	0	0	10.050	-11.111	-79	-0,11
CARS ALLIANCE AUTO LOANS SPAIN 2022, FONDO DE TITULIZACION	-509.840	0	90.493	-47.259	0	0	507.022	0	-43.338	-3,45
CEDULAS TDA 6, FTA	0	0	116.250	-116.250	0	0	0	0	0	0,00
COLUMBUS MASTER CREDIT CARDS, FONDO DE TITULIZACION	-428.847	0	118.807	-23.558	0	0	435.953	0	-87.000	-13,51

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)
EDT FTPYME PASTOR 3, FTA	0	0	45	-60	69	-51	250	-230	-34	-0,41
FONCAIXA FTGENCAT 5, FTA	0	0	3.559	-6.207	380	0	15.212	-14.796	-70	-0,07
FONCAIXA FTGENCAT 6, FTA	0	0	2.753	-4.262	415	0	10.586	-10.641	-64	-0,09
FTA SANTANDER FINANCIACION 1	0	0	83	-910	290	-137	2.230	-1.569	-70	-2,57
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 2	0	0	10.809	-10.972	12.381	-11.126	39.925	-43.528	-71	-0,03
FTA SANTANDER HIPOTECARIO 3	0	0	21.877	-22.069	24.799	-22.242	66.756	-77.678	-133	-0,03
FTA UCI 14	0	0	7.904	-8.015	0	0	36.580	-33.375	-3.111	-1,60
FTA UCI 16	0	0	14.360	-14.860	0	0	55.897	-51.021	-4.721	-1,40
FTA, UCI 15	0	0	10.291	-9.872	0	0	42.825	-41.048	-2.278	-0,93
FTA, UCI 17	0	0	12.673	-12.372	10.726	-10.748	51.329	-49.730	-2.074	-0,71
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA	0	0	195.035	-117.231	0	0	1.883.325	-1.458.000	-603	-0,01
FTH UCI 12	0	0	4.660	-4.199	0	0	19.761	-18.397	-1.363	-1,24
FONDO DE TITULIZACION PYMES SANTANDER 15	0	0	34.667	-49.174	0	0	331.625	-473.957	-279	-0,04
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VII	0	0	12.266	-15.466	8.589	0	36.226	-36.592	-4.855	-1,37
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO VIII	0	0	12.338	-12.394	1.200	0	37.047	-36.569	-519	-0,16
FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO X	0	0	15.229	-19.003	9.884	-108	41.299	-42.450	-4.331	-0,97
FONDO DE TITULIZACION SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1	0	0	20.787	-14.833	11.227	0	139.144	-143.658	-18.760	-7,08
FONDO DE TITULIZACION, RMBS PRADO IX	0	0	12.400	-17.492	10.447	0	32.851	-33.623	-5.824	-1,53
FTPYME TDA CAM 4, FTA	0	0	1.397	-1.348	199	-11	8.175	-7.943	-36	-0,05
GAT ICO-FTVPO 1, FTH	0	0	401	-816	580	-404	6.857	-6.941	-46	-0,23
GC FTPYME PASTOR 4, FTA	0	0	131	-1.370	159	-128	1.307	0	-33	-0,81
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA	0	0	4.765	-3.377	3.930	-4.246	19.334	-19.569	-41	-0,04
HIPOCAT 10, FTA	0	0	6.166	-3.974	6.595	-6.107	20.839	-24.977	-66	-0,05
HIPOCAT 11, FTA	0	0	6.787	-3.710	7.319	-6.662	21.144	-25.853	-88	-0,06
HIPOCAT 9, FTA	0	0	4.167	-6.442	4.394	-4.141	14.098	-14.374	-60	-0,06
IM ANDBANK RMBS 1,FONDO DE TITULIZACION	0	0	3.765	-3.778	0	0	25.053	-27.541	-194	-0,25
IM BCC CAJAMAR 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	15.755	-12.153	0	0	53.716	-55.626	-4.922	-1,62
IM BCC CAJAMAR 2 FONDO DE TITULIZACION	0	0	20.157	-192	0	0	77.025	-81.487	-21.145	-5,26
IM BCC CAJAMAR PYME 3, FONDO DE TITULIZACION	0	0	19.543	-13.717	0	0	127.478	-131.518	-3.230	-1,05
IM BCC CAJAMAR PYME 4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	21.956	-18.745	0	0	144.968	-150.900	-902	-0,21
IM BCC CAPITAL 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	8.218	-1.488	0	0	49.659	-54.699	-7.032	-5,33
IM BCG RMBS 2, FTA	0	0	18.399	-14.432	0	0	565.489	-449.783	-41.800	-
IM CAJAMAR 3, FTA	0	0	5.092	-4.926	0	0	131.543	-133.060	-10.806	n.s.
IM CAJAMAR 4, FTA	0	0	6.049	-5.760	0	150	23.174	-22.956	-1.043	-0,82
IM CAJAMAR 5, FTA	0	0	6.164	-6.173	0	0	21.302	-22.385	-214	-0,16
IM CAJAMAR 6, FTA	0	0	15.610	-16.904	0	0	52.474	-52.235	-2.155	-0,62
IM CAJASTUR MBS 1, FTA	0	0	7.444	-6.765	116	-359	25.744	-25.929	-154	-0,08

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 PASTOR 2, FTH	0	0	1.314	-1.416	229	0	8.065	-7.711	-67	-0,21
IM PASTOR 3, FTH	0	0	2.714	-3.932	0	-198	11.870	-9.307	-502	-0,62
IM PASTOR 4, FTA	0	0	3.813	-4.449	0	-41	17.788	-15.556	-113	-0,11
MADRID RMBS I, FTA	0	0	15.855	-14.582	0	-418	64.461	-65.382	-125	-0,03
MADRID RMBS II, FTA	0	0	13.840	-12.790	0	-242	51.758	-55.706	-114	-0,04
MADRID RMBS III FTA	0	0	29.030	-23.560	533	0	109.844	-115.674	-184	-0,03
MBS BANCAJA 4, FTA	0	0	8.789	-9.670	7.410	-7.238	36.605	-33.993	-4.492	-2,08
NORIA SPAIN 2020, FONDO DE TITULIZACION	-359.098	0	57.135	-30.006	0	0	350.511	0	-19.588	-2,25
PEPPER IBERIA CONSUMER 2024, FONDO DE TITULIZACION	-330.432	265.600	12.146	-2.297	336	0	71.826	-2.271	-4.985	-1,85
PRIVATE DRIVER ESPAÑA 2020-01, FONDO DE TITULIZACION	0	0	36.184	-487	0	0	619.849	-644.682	-15.132	-2,00
PROGRAMA CEDULAS TDA, FTA	0	0	217.388	-217.388	0	0	0	0	0	0,00
RMBS GREEN PRADO XI, FONDO DE TITULIZACION	0	0	16.653	-17.325	0	0	47.414	-45.701	-89	-0,02
RMBS MIRAVET 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	9.966	-10.202	0	0	26.402	-23.531	-1.732	-0,96
RMBS SANTANDER 6, FONDO DE TITULIZACION	0	0	123.472	-117.897	0	0	415.300	-469.040	-816	-0,03
RMBS SANTANDER 7, FONDO DE TITULIZACION	0	0	170.123	-131.139	0	0	482.174	-537.437	-1.043	-0,03
RURAL HIPOTECARIO IX, FTA	0	0	8.921	-8.752	7.516	-7.272	33.620	-33.895	-1.236	-0,64
RURAL HIPOTECARIO VIII, FTA	0	0	4.877	-4.990	4.219	-4.076	21.109	-21.731	-898	-0,84
RURAL HIPOTECARIO XIV, FTA	0	0	2.698	-2.583	0	0	10.267	-10.635	-32	-0,05
RURAL HIPOTECARIO XIX FONDO DE TITULIZACION	0	0	12.171	-11.179	0	0	43.295	-47.194	-101	-0,04
RURAL HIPOTECARIO XV, FTA	0	0	7.705	-7.389	0	0	26.095	-28.136	-43	-0,02
RURAL HIPOTECARIO XVI, FTA	0	0	1.790	-1.758	0	0	6.729	-7.907	-27	-0,06
RURAL HIPOTECARIO XVII, FTA	0	0	1.221	-834	0	0	4.409	-5.048	-27	-0,07
RURAL HIPOTECARIO XVIII, FONDO DE TITULIZACION	0	0	6.583	-5.696	0	0	20.867	-21.910	-586	-0,45
RURAL HIPOTECARIO XX, FONDO DE TITULIZACION	-650.336	650.000	18.714	-17.137	0	0	59.758	-51.982	-2.200	-0,35
SABADELL CONSUMER FINANCE AUTOS 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	34.777	-35.648	1.272	-824	212.349	-269.627	-4.105	-1,03
SABADELL CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	4.461	-4.216	3.100	0	51.367	-55.790	-91	-0,19
SABADELL CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION	0	0	24.824	-23.134	13.253	-6.162	151.340	-162.239	-1.293	-0,45
SABADELL CONSUMO 3, FONDO DE TITULIZACION	-749.979	759.200	14.141	-8.377	6.232	-4.671	53.206	-47.385	-6.882	-0,96
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2019-1 FONDO DE TITULIZACION	0	0	12.852	-7.410	6.411	-275	95.219	-97.054	-11.370	-8,98
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	8.641	-6.273	4.708	0	65.846	-67.397	-6.682	-6,68
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2022-01, FONDO DE TITULIZACION	0	0	39.902	-32.104	23.526	-9.867	205.122	-220.736	-17.068	-3,32
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2023-1, FONDO DE TITULIZACION	-143.486	0	47.149	-30.339	22.935	-21.158	137.781	-7.954	-914	-0,15
SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	-774.536	757.500	11.051	-5.747	4.570	-3.148	30.727	-5.282	-213	-0,03
SANTANDER CONSUMO 4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	31.346	-23.401	21.716	0	268.702	-278.488	-30.311	-8,72
SANTANDER CONSUMO 5, FONDO DE TITULIZACION	0	0	38.304	-36.678	23.019	-19.747	225.120	-239.956	-162	-0,03
SANTANDER CONSUMO 6, FONDO DE TITULIZACION	-1.431.632	1.224.000	38.906	-32.256	25.136	-18.964	241.276	-4.800	-175	-0,01

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)
SANTANDER CONSUMO 7, FONDO DE TITULIZACION	-1.200.000	1.215.600	4.329	0	0	0	43.269	0	0	0,00
SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION	-2.172.585	0	582.046	-707.516	178.731	0	2.177.631	0	-49.000	-0,29
TDA 19 - MIXTO, FTA	0	0	1.175	-1.315	0	-15	5.618	-5.761	-71	-0,20
TDA 22 - MIXTO, FTA	0	0	1.665	-1.953	0	-2	6.490	-5.890	-125	-0,29
TDA 24, FTA	0	0	6.608	-1.484	22	0	7.112	-8.843	-157	-0,30
TDA 25, FTA	0	0	8.813	-2.545	0	0	34.833	-37.869	-70	-0,99
TDA 26 - MIXTO, FTA	0	0	2.992	-3.269	0	-11	11.563	-12.140	-602	-0,83
TDA 27, FTA	0	0	5.557	-4.591	0	0	19.725	-19.977	-77	-0,06
TDA 28, FTA	0	0	4.004	-6.572	0	0	12.760	-8.776	-93	-0,08
TDA 29, FTA	0	0	5.311	-5.316	191	0	17.628	-18.015	-640	-0,53
TDA 30, FTA	0	0	3.788	-3.883	160	0	11.391	-11.281	-533	-0,63
TDA CAJAMAR 2, FTA	0	0	3.195	-2.904	0	-21	13.510	-13.785	-811	-1,09
TDA CAM 4, FTA	0	0	2.966	-2.731	202	0	18.750	-18.031	-1.410	-1,59
TDA CAM 5, FTA	0	0	8.946	-8.580	759	0	35.106	-34.523	-1.740	-0,76
TDA CAM 6, FTA	0	0	6.209	-5.995	644	0	22.987	-23.143	-84	-0,05
TDA CAM 7, FTA	0	0	10.444	-9.607	619	0	34.922	-34.355	-2.351	-0,88
TDA CAM 8, FTA	0	0	9.238	-9.015	568	0	36.323	-36.069	-1.708	-0,74
TDA CAM 9, FTA	0	0	9.869	-9.502	1.035	0	31.646	-31.755	-96	-0,04
TDA IBERCAJA 4, FTA	0	0	7.218	-7.412	0	-47	32.432	-32.788	-838	-0,53
TDA IBERCAJA 5, FTA	0	0	7.744	-7.756	43	0	31.623	-31.590	-955	-0,55
TDA IBERCAJA 6, FTA	0	0	12.995	-13.037	0	-40	48.100	-45.516	-1.706	-0,57
TDA IBERCAJA 7, FTA	0	0	24.320	-27.324	927	0	81.614	-88.695	-2.840	-0,49
TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	129.629	-143.355	25.653	0	399.698	-413.764	-199	-0,01
TDA TARRAGONA 1, FTA	0	0	2.214	-2.454	142	0	7.286	-6.965	-53	-0,09
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FTA	0	0	4.207	-4.142	3.448	-3.458	17.984	-17.845	-449	-0,49
Subtotal BONOS 2024	-19.016.521	14.740.001	5.370.103	-4.704.843	1.749.928	-1.163.437	23.836.360	-19.496.858	-954.338	-0,76
Subtotal BONOS 2023	-20.049.059	14.665.500	4.593.879	-3.899.318	1.353.359	-745.932	25.220.874	-21.851.717	-968.890	-0,74
%Variación	-5,15	0,51	16,90	20,66	29,30	55,97	-5,49	-10,78	-1,50	3,04
PAGARES										
Subtotal PAGARÉS 2024	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0,00
Subtotal PAGARÉS 2023	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										
ALCANTARA SHORT-TERM LENDING, FONDO DE TITULIZACION	-129.765	24.753	0	0	0	0	54.886	0	-1.699	-1,93
AQUA 2020, FONDO DE TITULIZACION	-37.397	0	2.996	-902	0	0	33.028	0	-1.770	-14,90
AQUISGRAN, FONDO DE TITULIZACION	-75.869	41.000	4.927	-3.619	0	0	33.861	0	-676	-0,34
AYT ADMINISTRACIONES I, FTA	0	0	933	-933	0	0	9.876	-9.876	-50	-0,49
BBVA VELA CORPORATE 2024-1, FONDO DE TITULIZACION	0	190.500	0	0	0	0	0	0	0	0,00
BOTHAR, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	3.453	-3.368	0	0	39.898	-39.693	-151	-0,19
CASA V, FONDO DE TITULIZACION	-29.165	29.377	675	0	0	0	2.160	0	0	0,00
CASA VI, FONDO DE TITULIZACION	-472.463	468.155	13.033	-11.336	0	0	33.329	-30.046	-1.973	-0,45
CESCE FONDO ANTICIPO DE FACTURAS, FONDO DE TITULIZACION	-514.342	177.171	4.129	-4.118	0	0	515.528	-183.582	-2.291	-1,78
CIMA SPAIN TELECOM, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	0	-2.926	1.940	0	0	0	0	0,00
CRISAE SENIOR DEBT FUND I, FONDO DE TITULIZACIÓN	-19.500	14.522	2.793	-2.433	0	0	5.000	0	-340	-0,74
CUBOS 2022, FONDO DE TITULIZACIÓN	-5.093	0	707	-401	0	0	9.335	-9.872	-349	-18,33
DACE, FONDO DE TITULIZACION	-81.880	39.220	3.219	-834	0	0	64.549	-19.418	-385	-1,70
EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION	-134.554	135.311	735	-371	0	0	124.070	-124.070	-272	-0,81
ELECNOR EFICIENCIA ENERGETICA 2020, FONDO DE TITULIZACIÓN	0	0	8.262	-530	0	0	13.733	-7.250	-14.881	-35,75
ENERGYA VM, FONDO DE TITULIZACION	-179	200	0	0	0	0	0	0	0	0,00
ESPAI BARÇA, FONDO DE TITULIZACION	-227.792	0	0	-68.263	33.208	-31.301	0	0	-4.484	-0,38
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 10	0	87.000	0	-4.842	0	0	0	0	-212	-0,21
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 11	0	197.100	0	0	0	0	0	0	0	0,00
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 6	0	0	0	-24.046	0	0	0	-47.587	-879	-0,50
FONDO DE TITULIZACION MAGDALENA 7	0	0	0	-14.291	0	0	0	-50.610	-435	-0,42
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA	0	0	0	-875	0	0	0	-2.475	-109	-2,07
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 2	0	0	0	-2.227	0	0	0	-7.817	-109	-0,70
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 3	0	0	0	-5.373	0	0	0	0	-157	-0,19
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 4	0	0	0	-3.693	0	0	0	-8.181	-154	-0,35
FONDO DE TITULIZACION PYMES MAGDALENA 5	0	0	0	-10.401	0	0	0	-41.374	-368	-0,72
FONDO DE TITULIZACION TAYRONA	0	180.000	0	0	0	0	0	0	0	0,00
FONDO DE TITULIZACION, CIMA SPAIN	0	0	578	-526	0	0	970	-970	0	0,00
FONDO DE TITULIZACION, LANTANA	-706	0	19.472	-19.418	0	0	37.303	-39.086	-83	-0,02
FTA2015, FTA	0	0	11.685	-53.600	0	0	50.875	0	-8.120	-2,48
HOLBORN, FONDO DE TITULIZACION	0	0	174	-252	0	0	8.993	-7.026	-1.438	-3,75
HT SUMINISTROS, FONDO DE TITULIZACION	-36.729	16.081	0	-594	0	0	44.241	-19.406	-967	-11,48
HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION	-76.740	35.364	0	-994	0	0	87.083	-43.306	-3.809	-14,19
ICF I BOND, FONDO DE TITULIZACION	0	0	848	-326	0	0	6.920	-6.920	-531	-2,75
IM ACP SHORT-TERM DEBT, FONDO DE TITULIZACION	-140.393	140.659	5.331	-4.712	0	0	160.669	-161.288	-316	-0,71
IM FORTIA 1, FONDO DE TITULIZACION	-547.690	107.703	4.385	-4.822	0	0	548.419	-116.878	-2.320	-2,57
IM GEDESCO INNOVFIN, FONDO DE TITULIZACION	0	0	750	-879	0	0	4.449	-10.547	-978	-11,63

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 MARLAN 1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	11.435	-10.955	0	0	47.500	-47.500	-1.050	-0,32
IM MARLAN 2, FONDO DE TITULIZACION	0	0	644	-530	0	0	0	0	-115	-0,49
IM SUMMA 1, FONDO DE TITULIZACION	-115.184	25.854	1.697	-1.186	0	0	123.401	-33.514	-980	-4,52
LINKFACTOR TRADE RECEIVABLES EUR 1, FONDO DE TITULIZACION	-52.016	34.929	0	0	0	0	57.817	-35.000	-5.669	-36,06
MICROWD, FONDO DE TITULIZACION	-1.596	1.900	42	-30	0	0	0	0	-101	-5,08
NB EPL, FONDO DE TITULIZACION	-27.000	27.480	4.647	-4.321	0	0	1.380	-1.380	-140	-0,11
NPLS UNSECURED, FONDO DE TITULIZACION	-5.478	4.847	3.889	-548	0	0	623	-1.615	-1.237	-8,18
OAK TRADE FINANCE, FONDO DE TITULIZACION	-23.661	17.072	672	-382	0	0	14.636	-293	-126	-0,74
PENINSULA, FONDO DE TITULIZACION	-20.550	18.500	3.464	-1.587	0	0	9.326	-10.087	-70	-0,13
PENSIUM ESG I, FONDO DE TITULIZACION	-5.234	5.400	0	0	0	0	0	0	-43	-0,80
PERFECTA SOLAR RESIDENCIAL, FONDO DE TITULIZACION	-10.120	8.136	1.670	-1.163	98	0	2.327	-81	-505	-1,95
RONDA FUNDING, FONDO DE TITULIZACION	-3.628	0	0	0	0	0	27	0	-75	-1,90
SACYR GREEN ENERGY MANAGEMENT, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	-2.696	0	0	20.390	-9.400	-8.314	-4,95
SALAMANCA, FONDO DE TITULIZACION	-133.699	133.800	18.157	-1.371	0	0	9.680	-12.336	-2.982	-2,00
SLF, FONDO DE TITULIZACION	0	0	6.858	-6.819	0	0	19.990	-17.489	-1.410	-2,08
SLF-2, FONDO DE TITULIZACION	0	0	1.246	-5.547	0	0	10.444	-6.290	-109	-0,20
SLF-3, FONDO DE TITULIZACION	-118.326	118.326	0	0	0	0	0	0	-73	-0,01
TDA 2015-1, FONDO DE TITULIZACION	0	0	32.720	-32.258	0	0	21.008	-21.232	-199	-0,44
TDA 2017-2, FONDO DE TITULIZACION	0	0	21.195	-20.884	0	0	25.714	-25.671	-168	-0,28
TDA 2017-4, FONDO DE TITULIZACION	0	0	0	0	0	0	486	-311	-57	-0,63
TDA ESP, FONDO DE TITULIZACION	0	0	8.239	-1.278	0	0	8.359	-11.503	-1.478	-1,63
TDA TITAN, FONDO DE TITULIZACION	0	0	21.638	-3.808	0	0	21.823	-34.274	-4.654	-3,65
TER 1, FONDO DE TITULIZACION	0	140.000	0	0	0	0	0	0	-303	-0,16
TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION	-251.703	20.000	0	-6.163	0	0	271.511	-20.000	-1.992	-2,04
UFASA CONSUMER FINANCE 2, FONDO DE TITULIZACION	-113.246	47.450	16.904	-7.831	0	0	73.400	-10.138	-9.163	-5,09
VERDE IBERIA LOANS, FONDO DE TITULIZACION	0	0	19.341	0	0	0	104.483	-110.403	-11.103	-5,41
WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION	-11.013	0	1.734	-909	0	0	9.448	0	-333	-2,01
WORKCAPITAL I, FONDO DE TITULIZACION	-32.620	0	10.654	0	0	0	23.698	0	-12.899	-81,45
Subtotal PRIVADOS 2024	-3.455.328	2.487.811	275.928	-362.171	35.246	-31.301	2.766.648	-1.395.797	-115.655	-1,54
Subtotal PRIVADOS 2023	-2.415.663	2.153.160	328.227	-461.972	17.620	-15.666	2.357.482	-1.439.240	-86.726	-1,43
%Variación	43,04	15,54	-15,93	-21,60	100,04	99,80	17,36	-3,02	33,36	7,59
Total 2024	-22.471.849	17.227.812	5.646.031	-5.067.014	1.785.174	-1.194.738	26.603.007	-20.892.654	-1.069.993	-0,80
Total 2023	-22.464.722	16.818.660	4.922.106	-4.361.290	1.370.979	-761.598	27.578.356	-23.290.957	-1.055.616	-0,77
%Variación	0,03	2,43	14,71	16,18	30,21	56,87	-3,54	-10,30	1,36	4,67

(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.