

			SECTOR	TITULOS	NOMINAL	VALOR ADQUISICION		VALOR VALORACION		PLUSV./MINUSV.	PERIODIF	% SOBRE	RATING	DUR.	TIR	SPREAD	
						EFFECTIVO	COTIZAC.	EFFECTIVO	COTIZAC.			TOTAL PATRIM.	R.FIJA	BONOS	de mercado		
	Depósito						4.088.026	0	4.088.026								
ES0170156006	FLAVIVA CORTO PLAZO -A-	Monetario	Fondos R.Fija	1.237.011	1.237.011	16.526.450	13	16.581.705	55.254	0		2,38%					
							20.614.477		20.669.731	55.254	0	9,65%					
ES0177043033	FCR ALTAMAR BUYOUT GLOBAL II	OINV	Fondos Capital-Riesgo	714.274	714.274	654.000	1	731.417	77.417	0		0,43%					
ES0108904030	FCR ALTAMAR BUYOUT EUROPA	OINV	Fondos Capital-Riesgo	576.668	576.668	598.532	1	740.442	141.910	0		0,43%					
FR0010362988	FCR LODH PRIVATE EQTY EURO CHOICE III	OINV	Fondos Capital-Riesgo	624.000	624.000	488.581	1	495.372	6.791	0		0,29%					
	INM OFICINA Y GARAJE C/CASTILLA 2, JAEN	OINV	Construcción-Inmobili	1	1	102.136		146.734	44.598	0		0,09%					
							1.843.249		2.113.964	270.715		1,23%					
IE0008063177	ETF ISHARES MSCI EMERGING MARKETS	FEUR	Fondos R.V.	47.000	47.000	1.527.030	30	1.427.625	-99.405	0		0,83%					
							1.527.030		1.427.625	-99.405	0	0,83%					
IE0031442068	ETF ISHARES S&P 500 INDEX FUND	RVUSA	Fondos R.V.	163.000	163.000	1.522.420	11,15	1.816.961	294.541	0		1,06%					
							1.522.420		1.816.961	294.541	0	1,06%					
ES0000101479	BO.COMUNIDAD MADRID 4,5% 041012	RENTA FIJA	CCAA y otras Corporaciones locales	1.000	1.000,000	999.663	99,90	999.000	-663	44.631		0,61%	Baa1	0,016	0,10	0,11	
ES00000121Q1	DEUDA ESTADO ESPAÑA FRN 291012	RENTA FIJA	Gobiernos	1.000	1.000,000	997.697	99,40	994.030	-3.667	555		0,58%	Baa2	0,084	0,07	0,07	
ES0L01212148	LET DEUDA ESTADO ESPAÑA 0 141212	RENTA FIJA	Gobiernos	2.500	2.500,000	2.401.393	96,65	2.413.776	12.384	78.020		1,45%	Baa2	0,210	0,02	0,01	
ES0012298005	CED AYT CAJAS GLOBAL FRN 1412121	RENTA FIJA	Cédulas multidentadas	8	8.000,000	734.730	98,89	791.120	56.390	108		0,46%	Baa2	0,208	0,06	0,05	
ES0413679111	CED BANKINTER SA 4,875% 210113	RENTA FIJA	Cédulas y Covered	20	1.000,000	998.630	100,42	1.004.150	5.520	33.832		0,60%	A3	0,313	0,03	0,03	
ES0000011660	DEUDA ESTADO ESPAÑA 6,15% 310113	RENTA FIJA	Gobiernos	49.004.484	490.405	554.945	101,16	496.094	-58.851	20.024		0,30%	Baa2	0,341	0,03	0,02	
ES0413679079	CED BANKINTER SA 2,625% 090413	RENTA FIJA	Cédulas y Covered	30	1.500,000	1.493.121	99,38	1.490.700	-2.421	18.771		0,88%	A3	0,526	0,04	0,03	
ES00000121T5	DEUDA ESTADO ESPAÑA 2,3% 300413	RENTA FIJA	Gobiernos	1.000	1.000,000	978.210	99,64	996.350	18.140	9.641		0,59%	Baa2	0,583	0,03	0,02	
X50625275010	BO.JUNTA DE ANDALUCIA 5,375% 130513	RENTA FIJA	CCAA y otras Corporaciones locales	16	800,000	802.495	97,72	781.760	-20.735	16.493		0,46%	Baa2	0,619	0,09	0,09	
X50633097299	BO INST CREDITO OFICIAL 3,875% 160513	RENTA FIJA	Emisores con garantía gubernamental	5.300	5.300,000	5.286.355	100,34	5.317.755	31.400	77.086		3,14%	Baa2	0,627	0,03	0,03	
ES0000101362	BO.COMUNIDAD MADRID 4,051% 120613	RENTA FIJA	CCAA y otras Corporaciones locales	2.000	2.000,000	1.979.377	98,29	1.965.800	-13.577	24.417		1,16%	Baa2	0,700	0,07	0,06	
ES0L01306213	LET DEUDA ESTADO ESPAÑA 0 210613	RENTA FIJA	Gobiernos	1.500	1.500,000	1.471.727	98,10	1.471.425	-302	211		0,86%	Baa2	0,725	0,03	0,02	
ES0000090607	BO.JUNTA ANDALUCIA 5,125% 080713	RENTA FIJA	CCAA y otras Corporaciones locales	300	300,000	301.689	96,50	289.500	-12.189	3.538		0,17%	Baa2	0,771	0,10	0,09	
X50503709411	BO.INSTITUTO CREDITO OFICIAL FRN 150713	RENTA FIJA	Emisores con garantía gubernamental	30	1.500,000	1.499.550	97,01	1.455.180	-44.370	2.777		0,85%	Baa2	0,048	0,04	0,04	
X50525700778	BO INST CREDITO OFICIAL 3,75% 150713	RENTA FIJA	Emisores con garantía gubernamental	1.000	1.000,000	1.012.100	100,15	1.001.500	-10.600	7.911		0,59%	Baa2	0,790	0,04	0,03	
X50746025336	BO.BVA SENIOR FINANCE 3% 220813	RENTA FIJA	Senior	13	1.300,000	1.294.657	99,88	1.298.427	3.770	4.167		0,76%	Baa1	0,893	0,03	0,03	
X50386473267	BO.INSTITUTO CREDITO OFICIAL 4,5% 100913	RENTA FIJA	Emisores con garantía gubernamental	7.280	7.280,000	7.382.012	100,81	7.338.604	-43.408	17.951		4,28%	Baa2	0,944	0,04	0,04	
ES0413790108	CED BANCO POPULAR ESPANOL 3,5% 130913	RENTA FIJA	Cédulas y Covered	20	1.000,000	991.323	99,20	992.010	687	1.630		0,58%	A3	0,953	0,04	0,04	
ES0378641049	BO.FADE 4,40% 170913	RENTA FIJA	Emisores con garantía gubernamental	45	4.500,000	4.454.850	100,57	4.525.785	70.935	7.052		2,64%	Baa2	0,983	0,04	0,03	
ES0413770019	BO.BANCO PASTOR SA 3,875% 200913	RENTA FIJA	Cédulas y Covered	8	800,000	795.352	98,99	791.920	-3.432	849		0,46%	A3	0,972	0,05	0,04	
ES0L01309209	LET DEUDA ESTADO ESPAÑA 0 200913	RENTA FIJA	Gobiernos	2.000	2.000,000	1.944.268	97,14	1.941.743	-2.525	1.359		1,13%	Baa2	0,972	0,03	0,02	
ES0413679095	CED BANKINTER SA 3,75% 230913	RENTA FIJA	Cédulas y Covered	10	500,000	496.700	99,90	499.500	2.800	360		0,29%	A3	0,980	0,04	0,03	
ES0314826068	BO.LIBERBANK 3,5% 081013	RENTA FIJA	Avalado por el Estado	14	700,000	703.073	98,88	692.181	-10.892	23.964		0,42%	Baa2	1,019	0,05	0,04	
ES0000090433	BO.JUNTA DE ANDALUCIA 4,3% 101013	RENTA FIJA	CCAA y otras Corporaciones locales	1.000	1.000,000	998.107	95,19	951.900	-46.207	41.825		0,58%	Baa2	1,024	0,09	0,09	
ES0302761038	BO.FUND ORDERED BANK RE 4,4% 211013	RENTA FIJA	Emisores con garantía gubernamental	15	1.500,000	1.487.295	100,63	1.509.450	22.155	62.213		0,91%	Baa2	1,053	0,04	0,03	
XS0551323057	BO.INST CREDITO OFICIAL 2,875% 151113	RENTA FIJA	Emisores con garantía gubernamental	1.500	1.500,000	1.459.800	99,10	1.486.425	26.625	37.705		0,89%	Baa2	1,120	0,04	0,03	
ES0314600158	BO.BANCO MARE NOSTRUM 4% 201113	RENTA FIJA	Avalado por el Estado	20	1.000,000	975.350	99,37	993.710	18.360	34.426		0,60%	Baa2	1,132	0,05	0,04	
ES0314950660	BO.BANCO FINANC Y AHORROS 3,875% 301113	RENTA FIJA	Avalado por el Estado	30	1.500,000	1.490.637	99,82	1.497.285	6.648	48.438		0,90%	Baa2	1,158	0,04	0,03	
ES0413211410	CED BANCO BILBAO VIZCAYA 4,125% 130114	RENTA FIJA	Cédulas y Covered	20	1.000,000	991.524	101,32	1.013.200	21.676	29.416		0,61%	A3	1,273	0,03	0,02	
FR0010709386	BO.BNP PARIBAS HOME LOAN 4,125% 150114	RENTA FIJA	Cédulas y Covered	30	1.500,000	1.509.647	100,73	1.507.875	61.229	43.786		0,94%	Aaa	1,278	0,00	0,00	
ES0413307028	BO.BANKIA SA 4% 280214	RENTA FIJA	Cédulas y Covered	22	1.100,000	1.098.955	95,42	1.049.598	-49.357	25.727		0,63%	Baa1	1,394	0,08	0,07	
ES0000101339	BO.COMUNIDAD MADRID 4,305% 060314	RENTA FIJA	CCAA y otras Corporaciones locales	3.500	3.500,000	3.512.212	96,99	3.394.650	-117.562	85.864		2,03%	Baa2	1,410	0,07	0,06	
ES0378641007	BO.FADE 4,80% 170314	RENTA FIJA	Emisores con garantía gubernamental	25	2.500,000	2.546.870	101,18	2.529.375	-17.495	64.767		1,51%	Baa2	1,437	0,04	0,03	
X50609191860	BO.INST CREDITO OFICIAL FRN 250314	RENTA FIJA	Emisores con garantía gubernamental	35	3.500,000	3.494.680	96,15	3.368.075	-129.605	962		1,96%	Baa2	1,225	0,05	0,05	
X50419352199	BO.REPSOL INTL FINANCE 6,5% 270314	RENTA FIJA	Petróleo	400	400,000	402.940	105,78	423.124	21.084	13.321		0,25%	Baa3	1,456	0,03	0,02	
ES0312360003	CED AYT CAJAS VI A 4% 070414	RENTA FIJA	Cédulas multidentadas	1	100,000	98.943	94,11	94.110	-4.833	1.929		0,06%	Baa1	1,495	0,08	0,08	
ES00000123D5	DEUDA ESTADO ESPAÑA 3,4% 300414	RENTA FIJA	Gobiernos	1.600	1.600,000	1.590.480	100,05	1.600.720	10.240	22.803		0,95%	Baa2	1,559	0,03	0,03	
ES0001361222	BO.JUNTA CASTILLA Y LEON 4,3% 070514	RENTA FIJA	CCAA y otras Corporaciones locales	1.000	1.000,000	1.020.590	94,50	945.000	-75.590	17.200		0,56%	Baa3	1,573	0,08	0,08	
ES0414970519	CED CAIXABANK 3,75% 260514	RENTA FIJA	Cédulas y Covered	40	2.000,000	1.998.224	99,95	1.999.000	776	26.096		1,18%	A3	1,626	0,04	0,03	
ES0312298237	CED AYT CAJAS GLOBAL 4,25% 290714	RENTA FIJA	Cédulas multidentadas	30	3.000,000	2.992.827	93,42	2.802.800	-190.027	22.007		1,64%	Baa1	1,791	0,08	0,08	
ES0314954084	BO.ibercaja BANCO 4,44% 300714	RENTA FIJA	Avalado por el Estado	30	1.500,000	1.493.772	99,40	1.491.960	-2.712	11.313		0,87%	Baa2	1,791	0,05	0,04	
ES0413211337	CED BANCO BILBAO VIZCAYA 3% 091014	RENTA FIJA	Cédulas y Covered	20	1.000,000	1.000.331	99,49	994.850	-5.481	29.262		0,60%	A3	1,991	0,03	0,03	
ES0414601023	CED CAJAMAR CAJA RURAL SSC 3,5% 231014	RENTA FIJA	Cédulas y Covered	20	2.000,000	1.937.565	94,49	1.889.800	-47.765	65.601		1,14%	Baa2	2,021	0,06	0,06	
ES0314840184	BO.CAIXA ESTALVIS CATALUNYA 3% 291014	RENTA FIJA	Avalado por el Estado	40	2.000,000	1.896.530	97,41	1.948.117	51.587	55.246		1,17%	Baa2	2,042	0,04	0,04	
ES0314400187	BO.CAJA DEL MEDITERRANEO 3% 121114	RENTA FIJA	Avalado por el Estado	20	1.000,000	943.237	95,45	964.520	21.283	26.475		0,58%	Baa2	2,078	0,05	0,04	
ES03123621009	CED AYT CAJAS VIII 4% 181114	RENTA FIJA	Cédulas multidentadas	5	500,000	503.720	92,76	463.800	-39.920	17.322		0,28%	A3	2,082	0,08	0,07	
ES0302761004	BO.FONDO REESTRUC ORD BANCARIA 3% 191114	RENTA FIJA	Emisores con garantía gubernamental	30	1.500,000	1.422.512	97,63	1.464.450	41.938	38.852		0,88%	Baa2	2,096	0,04	0,04	
ES00000122G0	DEUDA ESTADO ESPAÑA FRN 170315	RENTA FIJA	Gobiernos	4.000	4.000,000	3.981.112	99,11	3.644.400	-336.712	942		2,12%	Baa2	2,229	0,04	0,04	
ES0414970667	CED CAIXABANK 4,75% 180315	RENTA FIJA	Cédulas y Covered	17	85												

