

**S.01**

Denominación del Fondo: \_\_\_\_\_  
 Denominación del compartimento: \_\_\_\_\_  
 Denominación de la gestora: \_\_\_\_\_  
 Estados agregados: \_\_\_\_\_  
 Periodo: \_\_\_\_\_

[ACLARACIONES](#)

| <b>BALANCE</b> (miles de euros) |  | <b>Periodo actual</b><br>xx/xx/xxxx |  | <b>Periodo anterior</b><br>31/12/xxxx |
|---------------------------------|--|-------------------------------------|--|---------------------------------------|
|---------------------------------|--|-------------------------------------|--|---------------------------------------|

|               |  |  |  |  |
|---------------|--|--|--|--|
| <b>ACTIVO</b> |  |  |  |  |
|---------------|--|--|--|--|

|                               |      |      |      |      |
|-------------------------------|------|------|------|------|
| <b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b> | 0008 | suma | 1008 | suma |
|-------------------------------|------|------|------|------|

Suma (I+II+III)

|                                             |      |      |      |      |
|---------------------------------------------|------|------|------|------|
| <b>I. Activos financieros a largo plazo</b> | 0010 | suma | 1010 | suma |
|---------------------------------------------|------|------|------|------|

Suma (1+2+3+4)

|                                            |      |      |      |      |
|--------------------------------------------|------|------|------|------|
| <b>1. Valores representativos de deuda</b> | 0100 | suma | 1100 | suma |
|--------------------------------------------|------|------|------|------|

Suma (1.1:1.10)

|                                                        |      |  |      |  |
|--------------------------------------------------------|------|--|------|--|
| 1.1 Bancos centrales                                   | 0101 |  | 1101 |  |
| 1.2 Administraciones Públicas españolas                | 0102 |  | 1102 |  |
| 1.3 Entidades de crédito                               | 0103 |  | 1103 |  |
| 1.4 Otros sectores residentes                          | 0104 |  | 1104 |  |
| 1.5 Administraciones Públicas no residentes            | 0105 |  | 1105 |  |
| 1.6 Otros sectores no residentes                       | 0106 |  | 1106 |  |
| 1.7 Activos dudosos                                    | 0107 |  | 1107 |  |
| 1.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-) | 0108 |  | 1108 |  |
| 1.9 Intereses y gastos devengados no vencidos          | 0109 |  | 1109 |  |
| 1.10 Ajustes por operaciones de cobertura              | 0110 |  | 1110 |  |

|                               |      |      |      |      |
|-------------------------------|------|------|------|------|
| <b>2. Derechos de crédito</b> | 0200 | suma | 1200 | suma |
|-------------------------------|------|------|------|------|

Suma (2.1:2.23)

|                                                         |      |  |      |  |
|---------------------------------------------------------|------|--|------|--|
| 2.1 Participaciones hipotecarias                        | 0201 |  | 1201 |  |
| 2.2 Certificados de transmisión hipotecaria             | 0202 |  | 1202 |  |
| 2.3 Préstamos hipotecarios                              | 0203 |  | 1203 |  |
| 2.4 Cédulas Hipotecarias                                | 0204 |  | 1204 |  |
| 2.5 Préstamos a promotores                              | 0205 |  | 1205 |  |
| 2.6 Préstamos a PYMES                                   | 0206 |  | 1206 |  |
| 2.7 Préstamos a empresas                                | 0207 |  | 1207 |  |
| 2.8 Préstamos Corporativos                              | 0208 |  | 1208 |  |
| 2.9 Cédulas territoriales                               | 0209 |  | 1209 |  |
| 2.10 Bonos de Tesorería                                 | 0210 |  | 1210 |  |
| 2.11 Deuda Subordinada                                  | 0211 |  | 1211 |  |
| 2.12 Créditos AAPP                                      | 0212 |  | 1212 |  |
| 2.13 Préstamos Consumo                                  | 0213 |  | 1213 |  |
| 2.14 Préstamos automoción                               | 0214 |  | 1214 |  |
| 2.15 Cuotas de Arrendamiento financiero (leasing)       | 0215 |  | 1215 |  |
| 2.16 Cuentas a cobrar                                   | 0216 |  | 1216 |  |
| 2.17 Derechos de crédito futuros                        | 0217 |  | 1217 |  |
| 2.18 Bonos de titulización                              | 0218 |  | 1218 |  |
| 2.19 Otros                                              | 0219 |  | 1219 |  |
| 2.20 Activos dudosos                                    | 0220 |  | 1220 |  |
| 2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-) | 0221 |  | 1221 |  |
| 2.22 Intereses y gastos devengados no vencidos          | 0222 |  | 1222 |  |
| 2.23 Ajustes por operaciones de cobertura               | 0223 |  | 1223 |  |

|                     |      |      |      |      |
|---------------------|------|------|------|------|
| <b>3. Derivados</b> | 0230 | suma | 1230 | suma |
|---------------------|------|------|------|------|

Suma (3.1:3.2)

|                              |      |  |      |  |
|------------------------------|------|--|------|--|
| 3.1 Derivados de cobertura   | 0231 |  | 1231 |  |
| 3.2 Derivados de negociación | 0232 |  | 1232 |  |

|                                     |      |      |      |      |
|-------------------------------------|------|------|------|------|
| <b>4. Otros activos financieros</b> | 0240 | suma | 1240 | suma |
|-------------------------------------|------|------|------|------|

Suma (4.1:4.2)

|                           |      |  |      |  |
|---------------------------|------|--|------|--|
| 4.1 Garantías financieras | 0241 |  | 1241 |  |
| 4.2 Otros                 | 0242 |  | 1242 |  |

|                                          |      |  |      |  |
|------------------------------------------|------|--|------|--|
| <b>II. Activos por impuesto diferido</b> | 0250 |  | 1250 |  |
|------------------------------------------|------|--|------|--|

|                                         |      |  |      |  |
|-----------------------------------------|------|--|------|--|
| <b>III. Otros activos no corrientes</b> | 0260 |  | 1260 |  |
|-----------------------------------------|------|--|------|--|

|                                                            |      |      |      |      |                    |
|------------------------------------------------------------|------|------|------|------|--------------------|
| <b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>                                 | 0270 | suma | 1270 | suma | Suma (IV+V+VI+VII) |
| <b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>  | 0280 |      | 1280 |      |                    |
| <b>V. Activos financieros a corto plazo</b>                | 0290 | suma | 1290 | suma | Suma (1+2+3+4+5)   |
| 1. Deudores y otras cuentas a cobrar                       | 0300 |      | 1300 |      |                    |
| 2. Valores representativos de deuda                        | 0310 | suma | 1310 | suma | Suma (2.1:2.10)    |
| 2.1 Bancos centrales                                       | 0311 |      | 1311 |      |                    |
| 2.2 Administraciones Públicas españolas                    | 0312 |      | 1312 |      |                    |
| 2.3 Entidades de crédito                                   | 0313 |      | 1313 |      |                    |
| 2.4 Otros sectores residentes                              | 0314 |      | 1314 |      |                    |
| 2.5 Administraciones Públicas no residentes                | 0315 |      | 1315 |      |                    |
| 2.6 Otros sectores no residentes                           | 0316 |      | 1316 |      |                    |
| 2.7 Activos dudosos                                        | 0317 |      | 1317 |      |                    |
| 2.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)     | 0318 |      | 1318 |      |                    |
| 2.9 Intereses y gastos devengados no vencidos              | 0319 |      | 1319 |      |                    |
| 2.10 Ajustes por operaciones de cobertura                  | 0320 |      | 1320 |      |                    |
| 3. Derechos de crédito                                     | 0400 | suma | 1400 | suma | Suma (3.1:3.23)    |
| 3.1 Participaciones hipotecarias                           | 0401 |      | 1401 |      |                    |
| 3.2 Certificados de transmisión hipotecaria                | 0402 |      | 1402 |      |                    |
| 3.3 Préstamos hipotecarios                                 | 0403 |      | 1403 |      |                    |
| 3.4 Cédulas Hipotecarias                                   | 0404 |      | 1404 |      |                    |
| 3.5 Préstamos a promotores                                 | 0405 |      | 1405 |      |                    |
| 3.6 Préstamos a PYMES                                      | 0406 |      | 1406 |      |                    |
| 3.7 Préstamos a empresas                                   | 0407 |      | 1407 |      |                    |
| 3.8 Préstamos Corporativos                                 | 0408 |      | 1408 |      |                    |
| 3.9 Cédulas territoriales                                  | 0409 |      | 1409 |      |                    |
| 3.10 Bonos de Tesorería                                    | 0410 |      | 1410 |      |                    |
| 3.11 Deuda Subordinada                                     | 0411 |      | 1411 |      |                    |
| 3.12 Créditos AAPP                                         | 0412 |      | 1412 |      |                    |
| 3.13 Préstamos Consumo                                     | 0413 |      | 1413 |      |                    |
| 3.14 Préstamos automoción                                  | 0414 |      | 1414 |      |                    |
| 3.15 Arrendamiento financiero                              | 0415 |      | 1415 |      |                    |
| 3.16 Cuentas a cobrar                                      | 0416 |      | 1416 |      |                    |
| 3.17 Derechos de crédito futuros                           | 0417 |      | 1417 |      |                    |
| 3.18 Bonos de titulización                                 | 0418 |      | 1418 |      |                    |
| 3.19 Otros                                                 | 0419 |      | 1419 |      |                    |
| 3.20 Activos dudosos                                       | 0420 |      | 1420 |      |                    |
| 3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)    | 0421 |      | 1421 |      |                    |
| 3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos             | 0422 |      | 1422 |      |                    |
| 3.23 Ajustes por operaciones de cobertura                  | 0423 |      | 1423 |      |                    |
| 4. Derivados                                               | 0430 | suma | 1430 | suma | Suma (4.1:4.2)     |
| 4.1 Derivados de cobertura                                 | 0431 |      | 1431 |      |                    |
| 4.2 Derivados de negociación                               | 0432 |      | 1432 |      |                    |
| 5. Otros activos financieros                               | 0440 | suma | 1440 | suma | Suma (5.1:5.2)     |
| 5.1 Garantías financieras                                  | 0441 |      | 1441 |      |                    |
| 5.2 Otros                                                  | 0442 |      | 1442 |      |                    |
| <b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>                   | 0450 | suma | 1450 | suma | Suma (1+2)         |
| 1. Comisiones                                              | 0451 |      | 1451 |      |                    |
| 2. Otros                                                   | 0452 |      | 1452 |      |                    |
| <b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b> | 0460 | suma | 1460 | suma | Suma (1+2)         |
| 1. Tesorería                                               | 0461 |      | 1461 |      |                    |
| 2. Otros activos líquidos equivalentes                     | 0462 |      | 1462 |      |                    |
| <b>TOTAL ACTIVO</b>                                        | 0500 | suma | 1500 | suma | Suma (A+B)         |

|                                                                                  |      |      |      |      |                     |
|----------------------------------------------------------------------------------|------|------|------|------|---------------------|
| <b>PASIVO</b>                                                                    |      |      |      |      |                     |
| <b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>                                                    | 0650 | suma | 1650 | suma | Suma (I+II+III)     |
| <b>I. Provisiones a largo plazo</b>                                              | 0660 |      | 1660 |      |                     |
| <b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>                                     | 0700 | suma | 1700 | suma | Suma (1+2+3+4)      |
| 1. Obligaciones y otros valores negociables                                      | 0710 | suma | 1710 | suma | Suma (1.1:1.5)      |
| 1.1 Series no subordinadas                                                       | 0711 |      | 1711 |      |                     |
| 1.2 Series subordinadas                                                          | 0712 |      | 1712 |      |                     |
| 1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0713 |      | 1713 |      |                     |
| 1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos                                    | 0714 |      | 1714 |      |                     |
| 1.5 Ajustes por operaciones de cobertura                                         | 0715 |      | 1715 |      |                     |
| 2. Deudas con entidades de crédito                                               | 0720 | suma | 1720 | suma | Suma (2.1:2.6)      |
| 2.1 Préstamo subordinado                                                         | 0721 |      | 1721 |      |                     |
| 2.2 Crédito línea de liquidez                                                    | 0722 |      | 1722 |      |                     |
| 2.3 Otras deudas con entidades de crédito                                        | 0723 |      | 1723 |      |                     |
| 2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0724 |      | 1724 |      |                     |
| 2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos                                    | 0725 |      | 1725 |      |                     |
| 2.6 Ajustes por operaciones de cobertura                                         | 0726 |      | 1726 |      |                     |
| 3. Derivados                                                                     | 0730 | suma | 1730 | suma | Suma (3.1:3.2)      |
| 3.1 Derivados de cobertura                                                       | 0731 |      | 1731 |      |                     |
| 3.2 Derivados de negociación                                                     | 0732 |      | 1732 |      |                     |
| 4. Otros pasivos financieros                                                     | 0740 | suma | 1740 | suma | Suma (4.1:4.2)      |
| 4.1 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0741 |      | 1741 |      |                     |
| 4.2 Otros                                                                        | 0742 |      | 1742 |      |                     |
| <b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>                                        | 0750 |      | 1750 |      |                     |
| <b>B) PASIVO CORRIENTE</b>                                                       | 0760 | suma | 1760 | suma | Suma (IV+V+VI+VII)  |
| <b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b> | 0770 |      | 1770 |      |                     |
| <b>V. Provisiones a corto plazo</b>                                              | 0780 |      | 1780 |      |                     |
| <b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>                                     | 0800 | suma | 1800 | suma | Suma (1+2+3+4+5)    |
| 1. Acreedores y otras cuentas a pagar                                            | 0810 |      | 1810 |      |                     |
| 2. Obligaciones y otros valores negociables                                      | 0820 | suma | 1820 | suma | Suma (2.1:2.5)      |
| 2.1 Series no subordinadas                                                       | 0821 |      | 1821 |      |                     |
| 2.2 Series subordinadas                                                          | 0822 |      | 1822 |      |                     |
| 2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0823 |      | 1823 |      |                     |
| 2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos                                    | 0824 |      | 1824 |      |                     |
| 2.5 Ajustes por operaciones de cobertura                                         | 0825 |      | 1825 |      |                     |
| 3. Deudas con entidades de crédito                                               | 0830 | suma | 1830 | suma | Suma (3.1:3.6)      |
| 3.1 Préstamo subordinado                                                         | 0831 |      | 1831 |      |                     |
| 3.2 Crédito línea de liquidez                                                    | 0832 |      | 1832 |      |                     |
| 3.3 Otras deudas con entidades de crédito                                        | 0833 |      | 1833 |      |                     |
| 3.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0834 |      | 1834 |      |                     |
| 3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos                                    | 0835 |      | 1835 |      |                     |
| 3.6 Ajustes por operaciones de cobertura                                         | 0836 |      | 1836 |      |                     |
| 4. Derivados                                                                     | 0840 | suma | 1840 | suma | Suma (4.1:4.2)      |
| 4.1 Derivados de cobertura                                                       | 0841 |      | 1841 |      |                     |
| 4.2 Derivados de negociación                                                     | 0842 |      | 1842 |      |                     |
| 5. Otros pasivos financieros                                                     | 0850 | suma | 1850 | suma | Suma (5.1:5.2)      |
| 5.1 Importe bruto                                                                | 0851 |      | 1851 |      |                     |
| 5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0852 |      | 1852 |      |                     |
| <b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>                                        | 0900 |      | 1900 |      |                     |
| 1. Comisiones                                                                    | 0910 | suma | 1910 | suma | Suma (1.1:1.8)      |
| 1.1 Comisión sociedad gestora                                                    | 0911 |      | 1911 |      |                     |
| 1.2 Comisión administrador                                                       | 0912 |      | 1912 |      |                     |
| 1.3 Comisión agente financiero/pagos                                             | 0913 |      | 1913 |      |                     |
| 1.4 Comisión variable - resultados realizados                                    | 0914 |      | 1914 |      |                     |
| 1.5 Comisión variable - resultados no realizados                                 | 0915 |      | 1915 |      |                     |
| 1.6 Otras comisiones del cedente                                                 | 0916 |      | 1916 |      |                     |
| 1.7 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0917 |      | 1917 |      |                     |
| 1.8 Otras comisiones                                                             | 0918 |      | 1918 |      |                     |
| 2. Otros                                                                         | 0920 |      | 1920 |      |                     |
| <b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>       | 0930 | suma | 1930 | suma | Suma (VIII+IX+X+XI) |
| <b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>                       | 0940 |      | 1940 |      |                     |
| <b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>                                      | 0950 |      | 1950 |      |                     |
| <b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>                 | 0960 |      | 1960 |      |                     |
| <b>XI. Gastos de constitución en transición</b>                                  | 0970 |      | 1970 |      |                     |
| <b>TOTAL PASIVO</b>                                                              | 1000 | suma | 2000 | suma | Suma (A+B+C)        |

#### CONTROLES:

**TOTAL ACTIVO=TOTAL PASIVO (casilla 0500=casilla 1000 y casilla 1500=casilla 2000)**

Casilla 0940 = casilla 1940 + 6040 del estado S.04

Casilla 0950 = casilla 1940 + 6140 del estado S.05

Denominación del Fondo:  
Denominación del compartimento:  
Denominación de la gestora:  
Estados agregados:  
Período:

| CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)                       |             | P. corriente actual<br>(2º semestre) |             | P. corriente<br>anterior<br>(2º semestre) |             | Acumulado<br>actual<br>XX/XX/XXXX |             | Acumulado<br>anterior<br>XX/XX/XXXX | ACLARACIONES                |
|-----------------------------------------------------------------------|-------------|--------------------------------------|-------------|-------------------------------------------|-------------|-----------------------------------|-------------|-------------------------------------|-----------------------------|
| <b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>                         | <b>0100</b> | <b>suma</b>                          | <b>1100</b> | <b>suma</b>                               | <b>2100</b> | <b>suma</b>                       | <b>3100</b> | <b>suma</b>                         | Suma (1.1:1.3)              |
| 1.1 Valores representativos de deuda                                  | 0110        |                                      | 1110        |                                           | 2110        |                                   | 3110        |                                     |                             |
| 1.2 Derechos de crédito                                               | 0120        |                                      | 1120        |                                           | 2120        |                                   | 3120        |                                     |                             |
| 1.3 Otros activos financieros                                         | 0130        |                                      | 1130        |                                           | 2130        |                                   | 3130        |                                     |                             |
| <b>2. Intereses y cargas asimilados</b>                               | <b>0200</b> | <b>suma</b>                          | <b>1200</b> | <b>suma</b>                               | <b>2200</b> | <b>suma</b>                       | <b>3200</b> | <b>suma</b>                         | Suma (2.1:2.3)              |
| 2.1 Obligaciones y otros valores negociables                          | 0210        |                                      | 1210        |                                           | 2210        |                                   | 3210        |                                     |                             |
| 2.2 Deudas con entidades de crédito                                   | 0220        |                                      | 1220        |                                           | 2220        |                                   | 3220        |                                     |                             |
| 2.3 Otros pasivos financieros                                         | 0230        |                                      | 1230        |                                           | 2230        |                                   | 3230        |                                     |                             |
| <b>A) MARGEN DE INTERESES</b>                                         | <b>0250</b> | <b>suma</b>                          | <b>1250</b> | <b>suma</b>                               | <b>2250</b> | <b>suma</b>                       | <b>3250</b> | <b>suma</b>                         | Suma (1+2)                  |
| <b>3. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>                 | <b>0300</b> | <b>suma</b>                          | <b>1300</b> | <b>suma</b>                               | <b>2300</b> | <b>suma</b>                       | <b>3300</b> | <b>suma</b>                         | Suma (3.1:3.3)              |
| 3.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG         | 0310        |                                      | 1310        |                                           | 2310        |                                   | 3310        |                                     |                             |
| 3.2 Activos financieros disponibles para la venta                     | 0320        |                                      | 1320        |                                           | 2320        |                                   | 3320        |                                     |                             |
| 3.3 Otros                                                             | 0330        |                                      | 1330        |                                           | 2330        |                                   | 3330        |                                     |                             |
| <b>4. Diferencias de cambio (neto)</b>                                | <b>0400</b> |                                      | <b>1400</b> |                                           | <b>2400</b> |                                   | <b>3400</b> |                                     |                             |
| <b>5. Otros ingresos de explotación</b>                               | <b>0500</b> |                                      | <b>1500</b> |                                           | <b>2500</b> |                                   | <b>3500</b> |                                     |                             |
| <b>6. Otros gastos de explotación</b>                                 | <b>0600</b> | <b>suma</b>                          | <b>1600</b> | <b>suma</b>                               | <b>2600</b> | <b>suma</b>                       | <b>3600</b> | <b>suma</b>                         | Suma (6.1:6.3)              |
| 6.1 Servicios exteriores                                              | 0610        | <b>suma</b>                          | 1610        | <b>suma</b>                               | 2610        | <b>suma</b>                       | 3610        | <b>suma</b>                         | Suma (6.1.1:6.1.4)          |
| 6.1.1 Servicios de profesionales independientes                       | 0611        |                                      | 1611        |                                           | 2611        |                                   | 3611        |                                     |                             |
| 6.1.2 Servicios bancarios y similares                                 | 0612        |                                      | 1612        |                                           | 2612        |                                   | 3612        |                                     |                             |
| 6.1.3 Publicidad y propaganda                                         | 0613        |                                      | 1613        |                                           | 2613        |                                   | 3613        |                                     |                             |
| 6.1.4 Otros servicios                                                 | 0614        |                                      | 1614        |                                           | 2614        |                                   | 3614        |                                     |                             |
| 6.2 Tributos                                                          | 0620        |                                      | 1620        |                                           | 2620        |                                   | 3620        |                                     |                             |
| 6.3 Otros gastos de gestión corriente                                 | 0630        | <b>suma</b>                          | 1630        | <b>suma</b>                               | 2630        | <b>suma</b>                       | 3630        | <b>suma</b>                         | Suma (6.3.1:6.3.7)          |
| 6.3.1 Comisión de sociedad gestora                                    | 0631        |                                      | 1631        |                                           | 2631        |                                   | 3631        |                                     |                             |
| 6.3.2 Comisión administrador                                          | 0632        |                                      | 1632        |                                           | 2632        |                                   | 3632        |                                     |                             |
| 6.3.3 Comisión del agente financiero/pagos                            | 0633        |                                      | 1633        |                                           | 2633        |                                   | 3633        |                                     |                             |
| 6.3.4 Comisión variable - resultados realizados                       | 0634        |                                      | 1634        |                                           | 2634        |                                   | 3634        |                                     |                             |
| 6.3.5 Comisión variable - resultados no realizados                    | 0635        |                                      | 1635        |                                           | 2635        |                                   | 3635        |                                     |                             |
| 6.3.6 Otras comisiones del cedente                                    | 0636        |                                      | 1636        |                                           | 2636        |                                   | 3636        |                                     |                             |
| 6.3.7 Otros gastos                                                    | 0637        |                                      | 1637        |                                           | 2637        |                                   | 3637        |                                     |                             |
| <b>7. Deterioro de activos financieros (neto)</b>                     | <b>0700</b> | <b>suma</b>                          | <b>1700</b> | <b>suma</b>                               | <b>2700</b> | <b>suma</b>                       | <b>3700</b> | <b>suma</b>                         | Suma (7.1:7.4)              |
| 7.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda                | 0710        |                                      | 1710        |                                           | 2710        |                                   | 3710        |                                     |                             |
| 7.2 Deterioro neto de derechos de crédito                             | 0720        |                                      | 1720        |                                           | 2720        |                                   | 3720        |                                     |                             |
| 7.3 Deterioro neto de derivados                                       | 0730        |                                      | 1730        |                                           | 2730        |                                   | 3730        |                                     |                             |
| 7.4 Deterioro neto de otros activos financieros                       | 0740        |                                      | 1740        |                                           | 2740        |                                   | 3740        |                                     |                             |
| <b>8. Dotaciones a provisiones (neto)</b>                             | <b>0750</b> |                                      | <b>1750</b> |                                           | <b>2750</b> |                                   | <b>3750</b> |                                     |                             |
| <b>9. Ganancias (pérdidas) en la baja de activos no corrientes en</b> | <b>0800</b> |                                      | <b>1800</b> |                                           | <b>2800</b> |                                   | <b>3800</b> |                                     |                             |
| <b>10. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>                        | <b>0850</b> |                                      | <b>1850</b> |                                           | <b>2850</b> |                                   | <b>3850</b> |                                     |                             |
| <b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>                                | <b>0900</b> | <b>suma</b>                          | <b>1900</b> | <b>suma</b>                               | <b>2900</b> | <b>suma</b>                       | <b>3900</b> | <b>suma</b>                         | Suma (1+2+3+4+5+6+7+8+9+10) |
| <b>11. Impuesto sobre beneficios</b>                                  | <b>0950</b> |                                      | <b>1950</b> |                                           | <b>2950</b> |                                   | <b>3950</b> |                                     |                             |
| <b>RESULTADO DEL PERÍODO</b>                                          | <b>3000</b> | <b>suma</b>                          | <b>4000</b> | <b>suma</b>                               | <b>5000</b> | <b>suma</b>                       | <b>6000</b> | <b>suma</b>                         | Suma (B+11)                 |

Denominación del Fondo:  
Denominación del compartimento:  
Denominación de la gestora:  
Estados agregados:  
Periodo:

| ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO <i>(miles de euros)</i>                            |             | Periodo actual<br>xx/xx/xxxx | Periodo anterior<br>xx/xx/xxxx | ACLARACIONES                         |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------|------------------------------|--------------------------------|--------------------------------------|
|                                                                                 |             | suma                         | suma                           |                                      |
| <b>A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN</b>         | <b>8000</b> | <b>suma</b>                  | <b>9000</b>                    | <b>Suma (1+2+3)</b>                  |
| <b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>                   | <b>8100</b> | <b>suma</b>                  | <b>9100</b>                    | <b>Suma (1.1:1.6)</b>                |
| 1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados                               | 8110        |                              | 9110                           |                                      |
| 1.2 Intereses pagados por valores de titulización                               | 8120        |                              | 9120                           |                                      |
| 1.3 Intereses cobrados/pagados netos por operaciones de derivados               | 8130        |                              | 9130                           |                                      |
| 1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras                               | 8140        |                              | 9140                           |                                      |
| 1.5 Intereses pagados de préstamos y créditos en entidades de crédito           | 8150        |                              | 9150                           |                                      |
| 1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)                                     | 8160        |                              | 9160                           |                                      |
| <b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo</b>    | <b>8200</b> | <b>suma</b>                  | <b>9200</b>                    | <b>Suma (2.1:2.5)</b>                |
| 2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora                                    | 8210        |                              | 9210                           |                                      |
| 2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados                | 8220        |                              | 9220                           |                                      |
| 2.3 Comisiones pagadas al agente financiero                                     | 8230        |                              | 9230                           |                                      |
| 2.4 Comisiones variables pagadas                                                | 8240        |                              | 9240                           |                                      |
| 2.5 Otras comisiones                                                            | 8250        |                              | 9250                           |                                      |
| <b>3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo</b>            | <b>8300</b> | <b>suma</b>                  | <b>9300</b>                    | <b>Suma (3.1:3.3)</b>                |
| 3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos                       | 8310        |                              | 9310                           |                                      |
| 3.2 Pagos de provisiones                                                        | 8320        |                              | 9320                           |                                      |
| 3.3 Otros                                                                       | 8330        |                              | 9330                           |                                      |
| <b>B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSIÓN/ FINANCIACIÓN</b> | <b>8350</b> | <b>suma</b>                  | <b>9350</b>                    | <b>Suma (4+5+6+7)</b>                |
| <b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>           | <b>8400</b> | <b>suma</b>                  | <b>9400</b>                    | <b>Suma (4.1:4.2)</b>                |
| 4.1 Cobros por emisión de valores de titulización                               | 8410        |                              | 9410                           |                                      |
| 4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)     | 8420        |                              | 9420                           |                                      |
| <b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>                 | <b>8500</b> | <b>suma</b>                  | <b>9500</b>                    | <b>Suma (5.1:5.2)</b>                |
| 5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito                                | 8510        |                              | 9510                           |                                      |
| 5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras                      | 8520        |                              | 9520                           |                                      |
| <b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones</b>                               | <b>8600</b> | <b>suma</b>                  | <b>9600</b>                    | <b>Suma (6.1:6.3)</b>                |
| 6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito                              | 8610        |                              | 9610                           |                                      |
| 6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados                        | 8620        |                              | 1620                           |                                      |
| 6.3 Pagos por amortización de valores de titulización                           | 8630        |                              | 9630                           |                                      |
| <b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>                    | <b>8700</b> | <b>suma</b>                  | <b>9700</b>                    | <b>Suma (7.1:7.7)</b>                |
| 7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos             | 8710        |                              | 9710                           |                                      |
| 7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos                              | 8720        |                              | 9720                           |                                      |
| 7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso                               | 8730        |                              | 9730                           |                                      |
| 7.4 Administraciones públicas - Pasivo                                          | 8740        |                              | 9740                           |                                      |
| 7.5 Otros deudores y acreedores                                                 | 8750        |                              | 9750                           |                                      |
| 7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras                  | 8770        |                              | 9770                           |                                      |
| 7.7 Cobros de Subvenciones                                                      | 8780        |                              | 9780                           |                                      |
| <b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>             | <b>8800</b> | <b>suma</b>                  | <b>9800</b>                    | <b>S(C8000+C8350);S(C9000+C9350)</b> |
| Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo                                 | 8900        |                              | 9900                           |                                      |
| Efectivo o equivalentes al final del periodo                                    | 8990        |                              | 9990                           |                                      |

#### CONTROLES

1. Celda 8990=Celda 9900
2. Celda 8800=Celda 8990-Celda 8900 y Celda 9800; Idéntico para Celda 9990-Celda 9900
3. Celda 8990=Celda 0460 del S.01 (BALANCE)

Denominación del Fondo:  
Denominación del compartimento:  
Denominación de la gestora:  
Estados agregados:  
Período:

| INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)                                                                 |             | Periodo actual |             | Periodo anterior | ACLARACIONES    |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------|----------------|-------------|------------------|-----------------|
|                                                                                                                |             | xx/xx/xxxx     |             | xx/xx/xxxx       |                 |
| <b>1 Activos financieros disponibles para la venta</b>                                                         |             |                |             |                  |                 |
| 1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración                                                                        | 6010        | suma           | 7010        | suma             | Suma(1.1:1.1.2) |
| 1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración                                                 | 6020        |                | 7020        |                  |                 |
| 1.1.2 Efecto fiscal                                                                                            | 6021        |                | 7021        |                  |                 |
| 1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias                                                  | 6022        |                | 7022        |                  |                 |
| 1.3 Otras reclasificaciones                                                                                    | 6030        |                | 7030        |                  |                 |
| 1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período                                                  | 6040        |                | 7040        |                  |                 |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>                   | <b>6100</b> | <b>suma</b>    | <b>7100</b> | <b>suma</b>      | Suma(1.1:1.4)   |
| <b>2 Cobertura de los flujos de efectivo</b>                                                                   |             |                |             |                  |                 |
| 2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración                                                                        | 6110        | suma           | 7110        | suma             | Suma(2.1:2.1.2) |
| 2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración                                                 | 6120        |                | 7120        |                  |                 |
| 2.1.2 Efecto fiscal                                                                                            | 6121        |                | 7121        |                  |                 |
| 2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias                                                  | 6122        |                | 7122        |                  |                 |
| 2.3 Otras reclasificaciones                                                                                    | 6130        |                | 7130        |                  |                 |
| 2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período                                                  | 6140        |                | 7140        |                  |                 |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>                                            | <b>6200</b> | <b>suma</b>    | <b>7200</b> | <b>suma</b>      | Suma(2.1:2.4)   |
| <b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>                                               |             |                |             |                  |                 |
| 3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período | 6310        | suma           | 7310        | suma             | Suma(3.1:3.1.2) |
| 3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración                                                 | 6320        |                | 7320        |                  |                 |
| 3.1.2 Efecto fiscal                                                                                            | 6321        |                | 7321        |                  |                 |
| 3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias                                                  | 6322        |                | 7322        |                  |                 |
| 3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período                                                  | 6330        |                | 7330        |                  |                 |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>                                        | <b>6400</b> | <b>suma</b>    | <b>7400</b> | <b>suma</b>      | Suma(3.1:3.3)   |
| <b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>                                                          | <b>6500</b> | <b>suma</b>    | <b>7500</b> | <b>suma</b>      | Suma(1+2+3)     |

#### CONTROLES

1. Los totales de la Línea 18 deben ser iguales a CERO, en las Columnas D y F
2. Los totales de la Línea 27 deben ser iguales a CERO, en las Columnas D y F
3. Los totales de la Línea 35 deben ser iguales a CERO, en las Columnas D y F
4. Los totales de la Línea 37 deben ser iguales a CERO, en las Columnas D y F



S.05.1

Denominación del Fondo:  
Denominación del compartimento:  
Denominación de la gestora:  
Estados agregados:  
Periodo:  
Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACION

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

| CUADRO A | Situación actual xx/xx/xxxx             |                     |                       | Situación cierre anual anterior xx/xx/xxxx |                       |      |      | Situación inicial xx/xx/xxxx |                       |      |      | ACLARACIONES |
|----------|-----------------------------------------|---------------------|-----------------------|--------------------------------------------|-----------------------|------|------|------------------------------|-----------------------|------|------|--------------|
|          | Tipología de activos titulizados        | Nº de activos vivos | Importe pendiente (1) | Nº de activos vivos                        | Importe pendiente (1) |      |      | Nº de activos vivos          | Importe pendiente (1) |      |      |              |
|          | Participaciones hipotecarias            | 0001                | 0030                  | 0060                                       | 0090                  |      |      | 0120                         | 0150                  |      |      |              |
|          | Certificados de transmisión hipotecaria | 0002                | 0031                  | 0061                                       | 0091                  |      |      | 0121                         | 0151                  |      |      |              |
|          | Préstamos hipotecarios                  | 0003                | 0032                  | 0062                                       | 0092                  |      |      | 0122                         | 0152                  |      |      |              |
|          | Cédulas hipotecarias                    | 0004                | 0033                  | 0063                                       | 0093                  |      |      | 0123                         | 0153                  |      |      |              |
|          | Préstamos a promotores                  | 0005                | 0034                  | 0064                                       | 0094                  |      |      | 0124                         | 0154                  |      |      |              |
|          | Préstamos a PYMES                       | 0007                | 0036                  | 0066                                       | 0096                  |      |      | 0126                         | 0156                  |      |      |              |
|          | Préstamos a empresas                    | 0008                | 0037                  | 0067                                       | 0097                  |      |      | 0127                         | 0157                  |      |      |              |
|          | Préstamos Corporativos                  | 0009                | 0038                  | 0068                                       | 0098                  |      |      | 0128                         | 0158                  |      |      |              |
|          | Cédulas territoriales                   | 0010                | 0039                  | 0069                                       | 0099                  |      |      | 0129                         | 0159                  |      |      |              |
|          | Bonos de tesorería                      | 0011                | 0040                  | 0070                                       | 0100                  |      |      | 0130                         | 0160                  |      |      |              |
|          | Deuda subordinada                       | 0012                | 0041                  | 0071                                       | 0101                  |      |      | 0131                         | 0161                  |      |      |              |
|          | Créditos AAPP                           | 0013                | 0042                  | 0072                                       | 0102                  |      |      | 0132                         | 0162                  |      |      |              |
|          | Préstamos consumo                       | 0014                | 0043                  | 0073                                       | 0103                  |      |      | 0133                         | 0163                  |      |      |              |
|          | Préstamos automoción                    | 0015                | 0044                  | 0074                                       | 0104                  |      |      | 0134                         | 0164                  |      |      |              |
|          | Arrendamiento financiero                | 0016                | 0045                  | 0075                                       | 0105                  |      |      | 0135                         | 0165                  |      |      |              |
|          | Cuentas a cobrar                        | 0017                | 0046                  | 0076                                       | 0106                  |      |      | 0136                         | 0166                  |      |      |              |
|          | Derechos de crédito futuros             | 0018                | 0047                  | 0077                                       | 0107                  |      |      | 0137                         | 0167                  |      |      |              |
|          | Bonos de titulización                   | 0019                | 0048                  | 0078                                       | 0108                  |      |      | 0138                         | 0168                  |      |      |              |
|          | Otros                                   | 0020                | 0049                  | 0079                                       | 0109                  |      |      | 0139                         | 0169                  |      |      |              |
|          | Total                                   | 0021                | suma                  | 0050                                       | suma                  | 0110 | suma | 0140                         | suma                  | 0170 | suma |              |

(1) Entendiendo como importe pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

Cuadro de texto libre



| CUADRO B                                                                               |                                |                                               |              |
|----------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|-----------------------------------------------|--------------|
| Movimiento de la cartera de activos titulizados / Tasa de amortización anticipada      | Situación actual<br>xx/xx/xxxx | Situación cierre anual anterior<br>xx/xx/xxxx | ACLARACIONES |
| Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior                                  | 0200                           | 0210                                          |              |
| Amortización anticipada desde el cierre anual anterior                                 | 0201                           | 0211                                          |              |
| Total importe amortizado acumulado desde el origen del Fondo                           | 0202                           | 0212                                          |              |
| Importe pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1) | 0203                           | 0213                                          |              |
| Importe pendiente cierre del periodo (2)                                               | 0204                           | 0214                                          |              |
| Tasa amortización anticipada efectiva del periodo                                      | 0205                           | 0215                                          |              |

(1) En Fondos abiertos, importe de principal pendiente de reembolso en la fecha de presentación de la información de los nuevos activos incorporados en el periodo.

(2) Importe del principal pendiente de reembolso de la totalidad de los activos (incluidas las nuevas incorporaciones del periodo) a fecha del informe

- CONTROLES:
- 1. Suma 0214+0200+0201+0203 =0204 (suma algebraica, ya que las casillas 0200 y 0201 van en negativo)
  - 2. S.05.1 (Cuadro B) Casilla 0214= S.05.1 (Cuadro A) Casilla 0110
  - 3. S.05.1 (Cuadro B) Casilla 0204= S.05.1 (Cuadro A) Casilla 0050



CUADRO C

| CUADRO C             |               |      | Importe impagado |                      |      |       |                  |                                |      |      |             |      | ACLARACIONES                                      |
|----------------------|---------------|------|------------------|----------------------|------|-------|------------------|--------------------------------|------|------|-------------|------|---------------------------------------------------|
| Total Impagados (1)  | Nº de activos |      | rincip.          | Intereses ordinarios |      | Total |                  | Principal pendiente no vencido |      |      | Deuda Total |      |                                                   |
|                      |               |      |                  |                      |      |       |                  |                                |      |      |             |      |                                                   |
| Hasta 1 mes          | 0700          |      | 0710             |                      | 0720 | 0730  | Suma (0710+0720) | 0740                           |      |      | 0750        |      |                                                   |
| De 1 a 2 meses       | 0701          |      | 0711             |                      | 0721 | 0731  | Suma (0711+0721) | 0741                           |      |      | 0751        |      |                                                   |
| De 2 a 3 meses       | 0702          |      | 0712             |                      | 0722 | 0732  | Suma (0712+0722) | 0742                           |      |      | 0752        |      |                                                   |
| De 3 a 6 meses       | 0703          |      | 0713             |                      | 0723 | 0733  | Suma (0713+0723) | 0743                           |      |      | 0753        |      |                                                   |
| De 6 a 12 meses      | 0704          |      | 0714             |                      | 0724 | 0734  | Suma (0714+0724) | 0744                           |      |      | 0754        |      |                                                   |
| De 12 a 18 meses     | 0705          |      | 0715             |                      | 0725 | 0735  | Suma (0715+0725) | 0745                           |      |      | 0755        |      |                                                   |
| De 18 meses a 2 años | 0706          |      | 0716             |                      | 0726 | 0736  | Suma (0716+0726) | 0746                           |      |      | 0756        |      |                                                   |
| De 2 a 3 años        | 0707          |      | 0717             |                      | 0727 | 0737  | Suma (0717+0727) | 0747                           |      |      | 0757        |      |                                                   |
| Más de 3 años        | 0708          |      | 0718             |                      | 0728 | 0738  | Suma (0718+0728) | 0748                           |      |      | 0758        |      |                                                   |
| Total                | 0709          | suma | 0719             | suma                 | 0729 | suma  | 0739             | suma                           | 0749 | suma | 0759        | suma | 0750-0730-0740 = Intereses pendientes no vencidos |

(1) La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluido el de inicio e incluido el final (p.e. De 1 a 2 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 2 meses)

| Importe impagado                |      |               |      |         |      |                      |      |                  |      | Principal pendiente no vencido |      | Valor garantía (3) |      | % Deuda / v. Tasación |      | ACLARACIONES |
|---------------------------------|------|---------------|------|---------|------|----------------------|------|------------------|------|--------------------------------|------|--------------------|------|-----------------------|------|--------------|
| Impagados con garantía real (2) |      | Nº de activos |      | rincip. |      | Intereses ordinarios |      | Total            |      | Deuda Total                    |      |                    |      |                       |      |              |
| Hasta 1 mes                     | 0770 |               | 0780 |         | 0790 |                      | 0800 | Suma (0780+0790) | 0810 |                                | 0820 | Suma (0800+0810)   | 0830 |                       | 0840 |              |
| De 1 a 2 meses                  | 0771 |               | 0781 |         | 0791 |                      | 0801 | Suma (0781+0791) | 0811 |                                | 0821 | Suma (0801+0811)   | 0831 |                       | 0841 |              |
| De 2 a 3 meses                  | 0772 |               | 0782 |         | 0792 |                      | 0802 | Suma (0782+0792) | 0812 |                                | 0822 | Suma (0802+0812)   | 0832 |                       | 0842 |              |
| De 3 a 6 meses                  | 0773 |               | 0783 |         | 0793 |                      | 0803 | Suma (0783+0793) | 0813 |                                | 0823 | Suma (0803+0813)   | 0833 |                       | 0843 |              |
| De 6 a 12 meses                 | 0774 |               | 0784 |         | 0794 |                      | 0804 | Suma (0784+0794) | 0814 |                                | 0824 | Suma (0804+0814)   | 0834 |                       | 0844 |              |
| De 12 a 18 meses                | 0775 |               | 0785 |         | 0795 |                      | 0805 | Suma (0785+0795) | 0815 |                                | 0825 | Suma (0805+0815)   | 0835 |                       | 0845 |              |
| De 18 meses a 2 años            | 0776 |               | 0786 |         | 0796 |                      | 0806 | Suma (0786+0796) | 0816 |                                | 0826 | Suma (0806+0816)   | 0836 |                       | 0846 |              |
| De 2 a 3 años                   | 0777 |               | 0787 |         | 0797 |                      | 0807 | Suma (0787+0797) | 0817 |                                | 0827 | Suma (0807+0817)   | 0837 |                       | 0847 |              |
| Más de 3 años                   | 0778 |               | 0788 |         | 0798 |                      | 0808 | Suma (0788+0798) | 0818 |                                | 0828 | Suma (0808+0818)   | 0838 |                       | 0848 |              |
| Total                           | 0779 | suma          | 0789 | suma    | 0799 | suma                 | 0809 | suma             | 0819 | suma                           | 0829 | suma               | 0839 | suma                  | 0849 | %            |

(2) La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluido el de inicio e incluido el final (p.e. De 1 a 2 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 2 meses)

(3) Cumplimentar con la última valoración disponible de tasación del inmueble o valor razonable de la garantía real (acciones o deuda pignoradas etc) si el valor de las mismas se ha considerado en el momento inicial del Fondo.

CONTROLES:

Celdas 0849 = Celda 0829/0839



| CUADRO D                     | Situación actual xx/xx/xxxx |                      |                                          |                                     | Situación cierre anual anterior xx/xx/xxxx |                      |                                          |                                     | Escenario inicial           |                      |                                          |                                     | ACLARACIONES |
|------------------------------|-----------------------------|----------------------|------------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------------|----------------------|------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------|----------------------|------------------------------------------|-------------------------------------|--------------|
| Ratios de morosidad (1)      | Tasa de activos dudosos (A) |                      | Tasa de recuperación activos dudosos (C) |                                     | Tasa de activos dudosos (A)                |                      | Tasa de recuperación activos dudosos (C) |                                     | Tasa de activos dudosos (A) |                      | Tasa de recuperación activos dudosos (C) |                                     |              |
|                              | Tasa de activos dudosos (A) | Tasa de falloido (B) | Tasa de recuperación activos dudosos (C) | Tasa de recuperación fallosidos (D) | Tasa de activos dudosos (A)                | Tasa de falloido (B) | Tasa de recuperación activos dudosos (C) | Tasa de recuperación fallosidos (D) | Tasa de activos dudosos (A) | Tasa de falloido (B) | Tasa de recuperación activos dudosos (C) | Tasa de recuperación fallosidos (D) |              |
| Participaciones hipotecarias | 0850                        | 0868                 | 0886                                     | 0904                                | 0922                                       | 0940                 | 0958                                     | 0976                                | 0994                        | 1012                 | 1030                                     | 1048                                |              |
| Certificados de transmisión  | 0851                        | 0869                 | 0887                                     | 0905                                | 0923                                       | 0941                 | 0959                                     | 0977                                | 0995                        | 1013                 | 1031                                     | 1049                                |              |
| Préstamos hipotecarios       | 0852                        | 0870                 | 0888                                     | 0906                                | 0924                                       | 0942                 | 0960                                     | 0978                                | 0996                        | 1014                 | 1032                                     | 1050                                |              |
| Cédulas Hipotecarias         | 0853                        | 0871                 | 0889                                     | 0907                                | 0925                                       | 0943                 | 0961                                     | 0979                                | 0997                        | 1015                 | 1033                                     | 1051                                |              |
| Préstamos a promotores       | 0854                        | 0872                 | 0890                                     | 0908                                | 0926                                       | 0944                 | 0962                                     | 0980                                | 0998                        | 1016                 | 1034                                     | 1052                                |              |
| Prestamos a PYMES            | 0855                        | 0873                 | 0891                                     | 0909                                | 0927                                       | 0945                 | 0963                                     | 0981                                | 0999                        | 1017                 | 1035                                     | 1053                                |              |
| Préstamos a empresas         | 0856                        | 0874                 | 0892                                     | 0910                                | 0928                                       | 0946                 | 0964                                     | 0982                                | 1000                        | 1018                 | 1036                                     | 1054                                |              |
| Prestamos Corporativos       | 0857                        | 0875                 | 0893                                     | 0911                                | 0929                                       | 0947                 | 0965                                     | 0983                                | 1001                        | 1019                 | 1037                                     | 1055                                |              |
| Bonos de Tesorería           | 0858                        | 0876                 | 0894                                     | 0912                                | 0930                                       | 0948                 | 0966                                     | 0984                                | 1002                        | 1020                 | 1038                                     | 1056                                |              |
| Deuda Subordinada            | 0859                        | 0877                 | 0895                                     | 0913                                | 0931                                       | 0949                 | 0967                                     | 0985                                | 1003                        | 1021                 | 1039                                     | 1057                                |              |
| Créditos AAP                 | 0860                        | 0878                 | 0896                                     | 0914                                | 0932                                       | 0950                 | 0968                                     | 0986                                | 1004                        | 1022                 | 1040                                     | 1058                                |              |
| Préstamos Consumo            | 0861                        | 0879                 | 0897                                     | 0915                                | 0933                                       | 0951                 | 0969                                     | 0987                                | 1005                        | 1023                 | 1041                                     | 1059                                |              |
| Préstamos automoción         | 0862                        | 0880                 | 0898                                     | 0916                                | 0934                                       | 0952                 | 0970                                     | 0988                                | 1006                        | 1024                 | 1042                                     | 1060                                |              |
| Cuotas arrendamiento final   | 0863                        | 0881                 | 0899                                     | 0917                                | 0935                                       | 0953                 | 0971                                     | 0989                                | 1007                        | 1025                 | 1043                                     | 1061                                |              |
| Cuentas a cobrar             | 0864                        | 0882                 | 0900                                     | 0918                                | 0936                                       | 0954                 | 0972                                     | 0990                                | 1008                        | 1026                 | 1044                                     | 1062                                |              |
| Derechos de crédito futuro   | 0865                        | 0883                 | 0901                                     | 0919                                | 0937                                       | 0955                 | 0973                                     | 0991                                | 1009                        | 1027                 | 1045                                     | 1063                                |              |
| Bonos de titulación          | 0866                        | 0884                 | 0902                                     | 0920                                | 0938                                       | 0956                 | 0974                                     | 0992                                | 1010                        | 1028                 | 1046                                     | 1064                                |              |
| Otros                        | 0867                        | 0885                 | 0903                                     | 0921                                | 0939                                       | 0957                 | 0975                                     | 0993                                | 1011                        | 1029                 | 1047                                     | 1065                                |              |

(1) Estos ratios se referirán exclusivamente a la cartera de activos cedidos al Fondo (presentados en el balance en la partida de "derechos de credito")

(A) Determinada por el cociente entre el importe de principal pendiente de reembolso de los activos clasificados como dudoso y el resultado de minorar al importe de principal pendiente de reembolso del total de la cartera, el importe de principal pendiente de reembolso de los activos fallidos. La clasificación como dudosos se realizará con arreglo a lo previsto en las Normas 13ª y 23ª

(B) Determinada por el cociente entre el importe de principal pendiente de reembolso del total activos clasificados como fallidos y el resultado de minorar al importe de principal pendiente de reembolso del total de la cartera, el importe de principal pendiente de reembolso del total de activos fallidos. Se considera la definición de fallidos recogida en la Circular (no necesariamente coincidentes con la definición de la escritura o folleto, recogidas en el estado 5.4).

(C) Determinada por el cociente entre la suma de: el importe total de recuperaciones de impagados de principal de activos clasificados como dudosos, más el importe de principal pendiente de reembolso de los activos que salen de dudosos por las recuperaciones de principal producidas en el período, dividido por el importe de principal pendiente de reembolso de los activos clasificados como dudosos antes de las recuperaciones.

(D) Determinada por el cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos y el importe de principal pendiente de reembolso de activos clasificados como fallidos antes de las recuperaciones.



| CUADRO E                                          | Situación actual xx/xx/xxxx |      |                   |      | Situación cierre anual anterior xx/xx/xxxx |      |                   |      | Situación inicial xx/xx/xxxx |      |                   |      |              |
|---------------------------------------------------|-----------------------------|------|-------------------|------|--------------------------------------------|------|-------------------|------|------------------------------|------|-------------------|------|--------------|
| Vida residual de los activos cedidos al Fondo (1) | Nº de activos vivos         |      | Importe pendiente |      | Nº de activos vivos                        |      | Importe pendiente |      | Nº de activos vivos          |      | Importe pendiente |      | ACLARACIONES |
| Inferior a 1 año                                  | 1300                        |      | 1310              |      | 1320                                       | 1330 |                   |      | 1340                         |      | 1350              |      |              |
| Entre 1 y 2 años                                  | 1301                        |      | 1311              |      | 1321                                       | 1331 |                   |      | 1341                         |      | 1351              |      |              |
| Entre 2 y 3 años                                  | 1302                        |      | 1312              |      | 1322                                       | 1332 |                   |      | 1342                         |      | 1352              |      |              |
| Entre 3 y 5 años                                  | 1303                        |      | 1313              |      | 1323                                       | 1333 |                   |      | 1343                         |      | 1353              |      |              |
| Entre 5 y 10 años                                 | 1304                        |      | 1314              |      | 1324                                       | 1334 |                   |      | 1344                         |      | 1354              |      |              |
| Superior a 10 años                                | 1305                        |      | 1315              |      | 1325                                       | 1335 |                   |      | 1345                         |      | 1355              |      |              |
| Total                                             | 1306                        | suma | 1316              | suma | 1326                                       | suma | 1336              | suma | 1346                         | suma | 1356              | suma |              |
| Vida residual media ponderada (años)              | 1307                        |      |                   |      | 1327                                       |      |                   |      | 1347                         |      |                   |      |              |

(1) Los intervalos se entenderán excluido el inicio del mismo e incluido el final (p.e. Entre 1 y 2 años: superior a 1 año y menor o igual a 2 años)

| Antigüedad                 | Situación actual xx/xx/xxxx |  | Situación cierre anual anterior xx/xx/xxxx |  | Situación inicial xx/xx/xxxx |  |
|----------------------------|-----------------------------|--|--------------------------------------------|--|------------------------------|--|
|                            | Años                        |  | Años                                       |  | Años                         |  |
| Antigüedad media ponderada | 0630                        |  | 0632                                       |  | 0634                         |  |

CUADRES:

- 1. En S.05.1 (Cuadro A) Casilla 0050= S.05.1 (Cuadro E) Casilla 1316
- 2. En S.05.1 (Cuadro A) Casilla 0021= S.05.1 (Cuadro E) Casilla 1306
- 3. En S.05.1 (Cuadro A) Casilla 0080= S.05.1 (Cuadro E) Casilla 1326
- 4. En S.05.1 (Cuadro A) Casilla 0110= S.05.1 (Cuadro E) Casilla 1336
- 5. En S.05.1 (Cuadro A) Casilla 0140= S.05.1 (Cuadro E) Casilla 1347
- 6. En S.05.1 (Cuadro A) Casilla 0170= S.05.1 (Cuadro E) Casilla 1356



S.05.2

Denominación del Fondo:  
Denominación del compartimento:  
Denominación de la gestora:  
Estados agregados:  
Periodo de la declaración:  
Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)

CUADRO A

| CUADRO A  |                    | Situación actual xx/xx/xxxx |      |                  |                   |                               |             | Situación cierre anual anterior xx/xx/xxxx |      |                  |                   |                               |             | Escenario inicial xx/xx/xxxx |      |                  |                   |                                        |  |
|-----------|--------------------|-----------------------------|------|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------|--------------------------------------------|------|------------------|-------------------|-------------------------------|-------------|------------------------------|------|------------------|-------------------|----------------------------------------|--|
| Serie (2) | Denominación serie | Nº de pasivos emitidos      |      | Nominal unitario | Importe pendiente | Vida media de los pasivos (1) |             | Nº de pasivos emitidos                     |      | Nominal unitario | Importe pendiente | Vida media de los pasivos (1) |             | Nº de pasivos emitidos       |      | Nominal unitario | Importe pendiente | Vida media estimada de los pasivos (1) |  |
|           |                    | 0001                        |      | 0002             |                   | 0003                          |             | 0004                                       |      | 0005             |                   | 0006                          |             | 0007                         |      | 0008             |                   | 0009                                   |  |
|           |                    |                             |      |                  |                   |                               | 2 decimales |                                            |      |                  |                   |                               | 2 decimales |                              |      |                  |                   |                                        |  |
|           |                    |                             |      |                  |                   |                               | 2 decimales |                                            |      |                  |                   |                               | 2 decimales |                              |      |                  |                   |                                        |  |
|           |                    |                             |      |                  |                   |                               | 2 decimales |                                            |      |                  |                   |                               | 2 decimales |                              |      |                  |                   |                                        |  |
|           |                    |                             |      |                  |                   |                               | 2 decimales |                                            |      |                  |                   |                               | 2 decimales |                              |      |                  |                   |                                        |  |
|           |                    |                             |      |                  |                   |                               | 2 decimales |                                            |      |                  |                   |                               | 2 decimales |                              |      |                  |                   |                                        |  |
|           |                    |                             |      |                  |                   |                               | 2 decimales |                                            |      |                  |                   |                               | 2 decimales |                              |      |                  |                   |                                        |  |
| Total     |                    | 0006                        | suma |                  | 8025              | suma                          |             | 8045                                       | suma |                  | 8065              | suma                          |             | 8085                         | suma |                  | 8105              | suma                                   |  |

(1) Importes en años. En caso de ser estimado se indicará en las notas explicativas las hipótesis de la estimación.  
(2) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación.



| CUADRO B  |                    |                            |  |                          |  |             |               |                              |           |                     |      |                          | Importe pendiente    |                    |                     |                     |  |  |  |  |
|-----------|--------------------|----------------------------|--|--------------------------|--|-------------|---------------|------------------------------|-----------|---------------------|------|--------------------------|----------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--|--|--|--|
| Serie (2) | Denominación serie | Grado de subordinación (2) |  | Índice de referencia (3) |  | Margen (4)  | Tipo aplicado | Base de cálculo de intereses |           | Días Acumulados (5) |      | Intereses Acumulados (6) | Principal no vencido | Principal impagado | Intereses impagados | Total pendiente (7) |  |  |  |  |
|           |                    | 9950                       |  | 9960                     |  |             | 9970          | 9980                         | 9990      |                     | 9991 | 9993                     | 9994                 | 9995               | 9997                | 9998                |  |  |  |  |
|           |                    |                            |  |                          |  | 2 decimales |               | 2 decimales                  | 360 ó 365 |                     |      |                          |                      |                    |                     |                     |  |  |  |  |
|           |                    |                            |  |                          |  | 2 decimales |               | 2 decimales                  |           |                     |      |                          |                      |                    |                     |                     |  |  |  |  |
|           |                    |                            |  |                          |  | 2 decimales |               | 2 decimales                  |           |                     |      |                          |                      |                    |                     |                     |  |  |  |  |
|           |                    |                            |  |                          |  | 2 decimales |               | 2 decimales                  |           |                     |      |                          |                      |                    |                     |                     |  |  |  |  |
|           |                    |                            |  |                          |  | 2 decimales |               | 2 decimales                  |           |                     |      |                          |                      |                    |                     |                     |  |  |  |  |
|           |                    |                            |  |                          |  | 2 decimales |               | 2 decimales                  |           |                     |      |                          |                      |                    |                     |                     |  |  |  |  |
| Total     |                    |                            |  |                          |  |             |               |                              |           |                     |      | 9228 suma                | 9085 suma            | 9095 suma          | 9105 suma           | 9115 suma           |  |  |  |  |

(1) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación.

(2) La gestora deberá indicar si la serie es subordinada o no subordinada. (S=Subordinada; NS: No subordinada)

(3) La gestora deberá cumplimentar el índice de referencia que corresponda en cada caso (EURIBOR un año, EURIBOR a tres meses...). En el caso de tipos fijos esta columna se cumplimentará con el término "fijo".

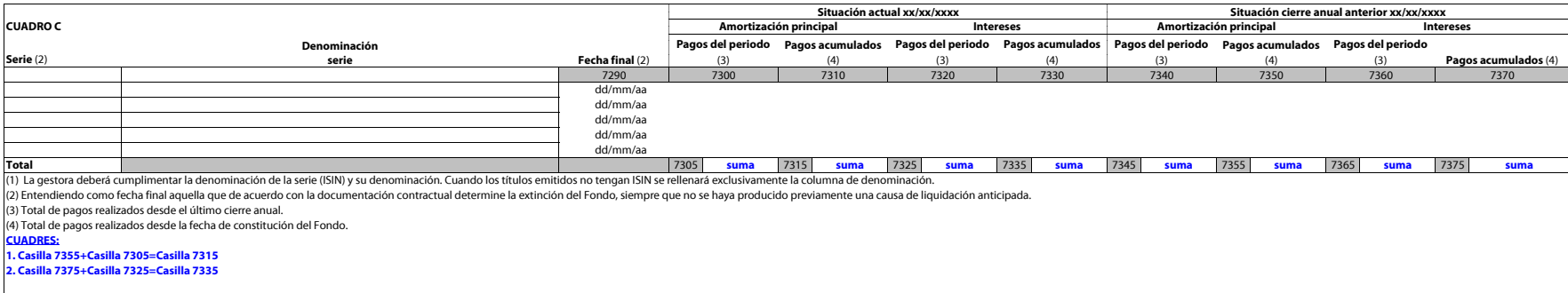
(4) En el caso de tipos fijos esta columna no se cumplimentará.

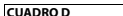
(5) Días acumulados desde la última fecha de pago.

(6) Intereses acumulados desde la última fecha de pago.

(7) Incluye el principal no vencido y todos los importes impagados a la fecha de la declaración.

CUADRE; S.05.2 (Cuadro b) Casilla 9115 = S.05.2 (Cuadro A) Casilla 8025





(2) La gestora deberá cumplimentar la calificación crediticia otorgada por cada agencia de rating, cuya denominación también deberá ser cumplimentada, para cada serie -MDY, para Moody's; SYP, para Standard & Poors, FCH para Fitch -

Denominación del Fondo:  
Denominación del compartimento:  
Denominación de la gestora:  
Estado agregado:  
Periodo:

**INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS**

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

|                                                                                                                       |      | Situación actual<br>xx/xx/xxxx |      | Situación cierre anual<br>anterior xx/xx/xxxx |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|--------------------------------|------|-----------------------------------------------|
| 1. Importe del Fondo de Reserva u otras mejoras equivalentes                                                          | 0010 |                                | 1010 |                                               |
| 2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados | 0020 |                                | 1020 |                                               |
| 3. Exceso de spread (%) (1)                                                                                           | 0040 |                                | 1040 |                                               |
| 4. Permuta financiera de intereses (S/N)                                                                              | 0050 |                                | 1050 |                                               |
| 5. Permuta financiera de tipos de cambio (S/N)                                                                        | 0070 |                                | 1070 |                                               |
| 6. Otras permutas financieras (S/N)                                                                                   | 0080 |                                | 1080 |                                               |
| 7. Importe disponible de la línea/s de liquidez (2)                                                                   | 0090 |                                | 1090 |                                               |
| 8. Subordinación de series (S/N)                                                                                      | 0110 |                                | 1110 |                                               |
| 9. Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos. (3)     | 0120 |                                | 1120 |                                               |
| 10. Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales                                                           | 0150 |                                | 1150 |                                               |
| 11. Porcentaje que representa el aval sobre el total de los pasivos emitidos                                          | 0160 |                                | 1160 |                                               |
| 12. Importe máximo de riesgo cubierto por derivados de crédito u otras garantías financieras adquiridas               | 0170 |                                | 1170 |                                               |
| 13. Otros (S/N) (4)                                                                                                   | 0180 |                                | 1180 |                                               |

(1) Diferencial existente entre los tipos de interés medios percibidos de la cartera de activos titulizados y el tipo de interés medio de los pasivos emitidos cuya finalidad ha sido la adquisición de los activos.

(2) Se incluirá el importe total disponible de las distintas líneas de liquidez en caso de que haya más de una.

(3) Entendiendo como no subordinadas aquellas series que en la fecha se encuentren, respecto a las demás, en una posición anterior para el cobro de capital conforme al orden de prelación de pagos.

(4) La gestora deberá incluir una descripción de dichas mejoras crediticias en las notas explicativas en caso de que las consideren relevantes

**Información sobre contrapartes de las mejoras crediticias**

|                                                                   |      | NIF |      | Denominación |
|-------------------------------------------------------------------|------|-----|------|--------------|
| Contraparte del Fondo de Reserva u otras mejoras equivalentes (5) | 0200 |     | 1210 |              |
| Permutas financieras de tipos de interés                          | 0210 |     | 1220 |              |
| Permutas financieras de tipos de cambio                           | 0220 |     | 1230 |              |
| Otras Permutas financieras                                        | 0230 |     | 1240 |              |
| Contraparte de la Línea de Liquidez                               | 0240 |     | 1250 |              |
| Entidad Avalista                                                  | 0250 |     | 1260 |              |
| Contraparte del derivado de crédito                               | 0260 |     | 1270 |              |

(5) Si el Fondo de Reserva se ha constituido a través de títulos emitidos y se desconoce el titular de esos títulos no se cumplimentará.

**CUADRE: S.05.3 Casilla 0010 / S.05.1 (Cuadro A) Casilla 0050 = S.05.3 Casilla 0020**

|                                 |  |
|---------------------------------|--|
| Denominación del Fondo:         |  |
| Denominación del compartimento: |  |
| Denominación de la gestora:     |  |
| Estado agregado:                |  |
| Periodo:                        |  |

**CIRCUNSTANCIAS ESPECÍFICAS ESTABLECIDAS CONTRACTUALMENTE EN EL FONDO**

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

| Concepto (1)                                                      | Importe Impagado acumulado |                |                  |                  | Ratio (2)        |                  |                      | Ref. Folleto |
|-------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------|------------------|------------------|------------------|------------------|----------------------|--------------|
|                                                                   | Meses<br>impago            | Días<br>impago | Situación actual | Período anterior | Situación actual | Período anterior | Última Fecha<br>Pago |              |
| 1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a  | 0010                       | 0030           | 0100             | 0200             | 0300             | 0400             | 1135                 |              |
| 2. Activos Morosos por otras razones                              |                            |                | 0110             | 0210             | 0310             | 0410             | 1130                 |              |
| <b>Total Morosos</b>                                              | 0020                       | 0040           | 0120             | <b>suma</b> 0220 | <b>suma</b> 0320 | 0420             | 1140                 | 1280         |
| 3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a | 0050                       | 0060           | 0130             | 0230             | 0330             | 0430             | 1150                 |              |
| 4. Activos Fallidos por otras razones                             |                            |                | 0140             | 0240             | 0340             | 0440             | 1160                 |              |
| <b>Total Fallidos</b>                                             | 0070                       | 0080           | 0150             | <b>suma</b> 0250 | <b>suma</b> 0350 | 0450             | 1200                 | 1290         |

(1) En caso de existir definiciones adicionales a las recogidas en la presente tabla (moras cualificadas, fallidos subjetivos, etc) respecto a las que se establezca algún trigger se indicarán en la tabla de Otros ratios relevantes, indicando el nombre del ratio.

(2) Las ratios se corresponden al importe total de activos fallidos o morosos entre el saldo vivo de los activos cedidos al fondo según se defina en la documentación contractual. En la columna Ref. Folleto se indicará el epígrafe o capítulo del folleto en el que el concepto esté definido

|                         |  | Ratio (2)        |                  |                   |              |
|-------------------------|--|------------------|------------------|-------------------|--------------|
| Otras ratios relevantes |  | Situación actual | Periodo anterior | Última Fecha Pago | Ref. Folleto |
|                         |  | 0160             | 0260             | 0360              | 0460         |
|                         |  | 0170             | 0270             | 0370              | 0470         |
|                         |  | 0180             | 0280             | 0380              | 0480         |
|                         |  | 0190             | 0290             | 0390              | 0490         |

[illegible]

(3) En caso de existir triggers adicionales a los recogidos en la presente tabla se indicarán su nombre o concepto debajo de OTROS TRIGGERS. Si los triggers recogidos expresamente en la tabla no están previstos en el Fondo, no se cumplimentarán

(4) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al modo de amortización (prorrata/secuencial) de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN, y en su defecto el nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

(5) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al diferimiento o postergamiento de intereses de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN o nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia la engrama del folleto donde está definido.

(6) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto a la no reducción del fondo de reserva se indicará el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido.

Cuadro de texto libre(7)

|  |
|--|
|  |
|--|



S.05.5

Denominación del Fondo:  
Denominación del compartimento:  
Denominación de la gestora:  
Estado agregado:  
Periodo:

OTRA INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO A

| Distribución geográfica activos titulizados | Situación actual xx/xx/xxxx |      |                          |      | Situación cierre anual anterior<br>31/12/xxxx |      |                          |      | Situación inicial xx/xx/xxxx |      |                       |      |
|---------------------------------------------|-----------------------------|------|--------------------------|------|-----------------------------------------------|------|--------------------------|------|------------------------------|------|-----------------------|------|
|                                             | Nº de activos vivos         |      | Importe pendiente<br>(1) |      | Nº de activos vivos                           |      | Importe pendiente<br>(1) |      | Nº de activos vivos          |      | Importe pendiente (1) |      |
|                                             |                             |      |                          |      |                                               |      |                          |      |                              |      |                       |      |
| Andalucía                                   | 0400                        |      | 0426                     |      | 0452                                          |      | 0478                     |      | 0504                         |      | 0530                  |      |
| Aragón                                      | 0401                        |      | 0427                     |      | 0453                                          |      | 0479                     |      | 0505                         |      | 0531                  |      |
| Asturias                                    | 0402                        |      | 0428                     |      | 0454                                          |      | 0480                     |      | 0506                         |      | 0532                  |      |
| Baleares                                    | 0403                        |      | 0429                     |      | 0455                                          |      | 0481                     |      | 0507                         |      | 0533                  |      |
| Canarias                                    | 0404                        |      | 0430                     |      | 0456                                          |      | 0482                     |      | 0508                         |      | 0534                  |      |
| Cantabria                                   | 0405                        |      | 0431                     |      | 0457                                          |      | 0483                     |      | 0509                         |      | 0535                  |      |
| Castilla-León                               | 0406                        |      | 0432                     |      | 0458                                          |      | 0484                     |      | 0510                         |      | 0536                  |      |
| Castilla La Mancha                          | 0407                        |      | 0433                     |      | 0459                                          |      | 0485                     |      | 0511                         |      | 0537                  |      |
| Cataluña                                    | 0408                        |      | 0434                     |      | 0460                                          |      | 0486                     |      | 0512                         |      | 0538                  |      |
| Ceuta                                       | 0409                        |      | 0435                     |      | 0461                                          |      | 0487                     |      | 0513                         |      | 0539                  |      |
| Extremadura                                 | 0410                        |      | 0436                     |      | 0462                                          |      | 0488                     |      | 0514                         |      | 0540                  |      |
| Galicia                                     | 0411                        |      | 0437                     |      | 0463                                          |      | 0489                     |      | 0515                         |      | 0541                  |      |
| Madrid                                      | 0412                        |      | 0438                     |      | 0464                                          |      | 0490                     |      | 0516                         |      | 0542                  |      |
| Melilla                                     | 0413                        |      | 0439                     |      | 0465                                          |      | 0491                     |      | 0517                         |      | 0543                  |      |
| Murcia                                      | 0414                        |      | 0440                     |      | 0466                                          |      | 0492                     |      | 0518                         |      | 0544                  |      |
| Navarra                                     | 0415                        |      | 0441                     |      | 0467                                          |      | 0493                     |      | 0519                         |      | 0545                  |      |
| La Rioja                                    | 0416                        |      | 0442                     |      | 0468                                          |      | 0494                     |      | 0520                         |      | 0546                  |      |
| Comunidad Valenciana                        | 0417                        |      | 0443                     |      | 0469                                          |      | 0495                     |      | 0521                         |      | 0547                  |      |
| País Vasco                                  | 0418                        |      | 0444                     |      | 0470                                          |      | 0496                     |      | 0522                         |      | 0548                  |      |
| <b>Total España</b>                         | 0419                        | suma | 0445                     | suma | 0471                                          | suma | 0497                     | suma | 0523                         | suma | 0549                  | suma |
| Otros países Unión Europea                  | 0420                        |      | 0446                     |      | 0472                                          |      | 0498                     |      | 0524                         |      | 0550                  |      |
| Resto                                       | 0422                        |      | 0448                     |      | 0474                                          |      | 0500                     |      | 0526                         |      | 0552                  |      |
| <b>Total general</b>                        | 0425                        | suma | 0450                     | suma | 0475                                          | suma | 0501                     | suma | 0527                         | suma | 0553                  | suma |

(1) Entendiendo como importe pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

CUADRES:

1. Casilla 0425=Casilla 0021 del Cuadro S.05.1 Cuadro A
2. Casilla 0450=Casilla 0050 del Cuadro S.05.1 Cuadro A
3. Casilla 0475=Casilla 0080 del Cuadro S.05.1 Cuadro A
4. Casilla 0501=Casilla 0110 del Cuadro S.05.1 Cuadro A
5. Casilla 0527=Casilla 0140 del Cuadro S.05.1 Cuadro A
6. Casilla 0553=Casilla 0170 del Cuadro S.05.1 Cuadro A



CUADRO B

| Situación actual xx/xx/xxxx  |      |                     |      |                   |      |                   |  |                     |      | Situación cierre anual anterior 31/12/xxxx |  |                   |      |                     |      |                   |      |                   |      | Situación inicial xx/xx/xxxx |  |                   |      |                   |      |  |      |      |  |
|------------------------------|------|---------------------|------|-------------------|------|-------------------|--|---------------------|------|--------------------------------------------|--|-------------------|------|---------------------|------|-------------------|------|-------------------|------|------------------------------|--|-------------------|------|-------------------|------|--|------|------|--|
| Divisa / Activos titulizados |      | Nº de activos vivos |      | Importe pendiente |      | Importe pendiente |  | Nº de activos vivos |      | Importe pendiente                          |  | Importe pendiente |      | Nº de activos vivos |      | Importe pendiente |      | Importe pendiente |      | Nº de activos vivos          |  | Importe pendiente |      | Importe pendiente |      |  |      |      |  |
|                              |      |                     |      | en Divisa (1)     |      | en euros (1)      |  |                     |      | en Divisa (1)                              |  | en euros (1)      |      |                     |      | en Divisa (1)     |      | en euros (1)      |      |                              |  | en Divisa (1)     |      | en euros (1)      |      |  |      |      |  |
| Euro - EUR                   | 0571 |                     | 0577 |                   | 0583 |                   |  | 0600                |      | 0606                                       |  | 0611              |      |                     | 0620 |                   | 0626 |                   | 0631 |                              |  |                   | 0620 |                   | 0626 |  | 0631 |      |  |
| EEUU Dólar - USD             | 0572 |                     | 0578 |                   | 0584 |                   |  | 0601                |      | 0607                                       |  | 0612              |      |                     | 0621 |                   | 0627 |                   | 0632 |                              |  |                   | 0621 |                   | 0627 |  | 0632 |      |  |
| Japón Yen - JPY              | 0573 |                     | 0579 |                   | 0585 |                   |  | 0602                |      | 0608                                       |  | 0613              |      |                     | 0622 |                   | 0628 |                   | 0633 |                              |  |                   | 0622 |                   | 0628 |  | 0633 |      |  |
| Reino Unido Libra - GBP      | 0574 |                     | 0580 |                   | 0586 |                   |  | 0603                |      | 0609                                       |  | 0614              |      |                     | 0623 |                   | 0629 |                   | 0634 |                              |  |                   | 0623 |                   | 0629 |  | 0634 |      |  |
| Otras                        | 0575 |                     |      |                   | 0587 |                   |  | 0604                |      |                                            |  | 0615              |      |                     | 0624 |                   |      |                   | 0635 |                              |  |                   | 0624 |                   |      |  | 0635 |      |  |
| Total                        | 0576 | suma                |      |                   | 0588 | suma              |  | 0605                | suma |                                            |  | 0616              | suma |                     | 0625 | suma              |      |                   | 0636 | suma                         |  |                   | 0625 | suma              |      |  | 0636 | suma |  |

(1) Entendiendo como importe pendiente el importe de principal pendiente de reembolso.

**CUADRES:**

1. Casilla 0576=Casilla 0021 de S.05.1 Cuadro A
2. Casilla 0588=Casilla 0050 de S.05.1 Cuadro A
3. Casilla 0605=Casilla 0080 de S.05.1 Cuadro A
4. Casilla 0616=Casilla 0110 de S.05.1 Cuadro A
5. Casilla 0625=Casilla 0140 de S.05.1 Cuadro A
6. Casilla 0636=Casilla 0170 de S.05.1 Cuadro A



CUADRO C

| Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (1) | Situación actual xx/xx/xxxx |      |                   |      | Situación cierre anual anterior<br>31/12/xxxx |      |                   |      | Situación inicial xx/xx/xxxx |      |                   |      |
|------------------------------------------------------------|-----------------------------|------|-------------------|------|-----------------------------------------------|------|-------------------|------|------------------------------|------|-------------------|------|
|                                                            | Nº de activos vivos         |      | Importe pendiente |      | Nº de activos vivos                           |      | Importe pendiente |      | Nº de activos vivos          |      | Importe pendiente |      |
| 0% - 40%                                                   | 1100                        |      | 1110              |      | 1120                                          |      | 1130              |      | 1140                         |      | 1150              |      |
| 40% - 60%                                                  | 1101                        |      | 1111              |      | 1121                                          |      | 1131              |      | 1141                         |      | 1151              |      |
| 60% - 80%                                                  | 1102                        |      | 1112              |      | 1122                                          |      | 1132              |      | 1142                         |      | 1152              |      |
| 80% - 100%                                                 | 1103                        |      | 1113              |      | 1123                                          |      | 1133              |      | 1143                         |      | 1153              |      |
| 100% - 120%                                                | 1104                        |      | 1114              |      | 1124                                          |      | 1134              |      | 1144                         |      | 1154              |      |
| 120% - 140%                                                | 1105                        |      | 1115              |      | 1125                                          |      | 1135              |      | 1145                         |      | 1155              |      |
| 140% - 160%                                                | 1106                        |      | 1116              |      | 1126                                          |      | 1136              |      | 1146                         |      | 1156              |      |
| superior al 160%                                           | 1107                        |      | 1117              |      | 1127                                          |      | 1137              |      | 1147                         |      | 1157              |      |
| <b>Total</b>                                               | 1108                        | suma | 1118              | suma | 1128                                          | suma | 1138              | suma | 1148                         | suma | 1158              | suma |
| <b>Media ponderada (%)</b>                                 |                             |      | 1119              |      |                                               |      | 1139              |      |                              |      | 1159              |      |

(1) Distribución según el valor de la razón entre el importe pendiente de amortizar de los préstamos con garantía real y la última valoración disponible de tasación de los inmuebles hipotecados, o valor razonable de otras garantías reales, siempre que el valor de las mismas se haya considerado en el momento inicial del Fondo, expresada en porcentaje.



**CUADRO D**

**Rendimiento índice del periodo**

|                          | Número de activos<br>vivos | Importe Pendiente | Margen ponderado<br>s/ índice de<br>referencia | Tipo de interés medio<br>ponderado (2) |
|--------------------------|----------------------------|-------------------|------------------------------------------------|----------------------------------------|
| Índice de referencia (1) | 1400                       | 1410              | 1420                                           | 1430                                   |

|              |      |      |      |      |      |  |      |
|--------------|------|------|------|------|------|--|------|
| <b>Total</b> | 1405 | suma | 1415 | suma | 1425 |  | 1435 |
|--------------|------|------|------|------|------|--|------|

(1) La gestora deberá cumplimentar el índice de referencia que corresponda en cada caso (EURIBOR un año, LIBOR....).

(2) En el caso de tipos fijos no se cumplimentará la columna de margen ponderado y se indicará el tipo de interés medio ponderado de los activos a tipo fijo en la columna de "tipo de interés medio ponderado".

**CUADRES:**

1. Casilla 1405=Casilla 0021 en S.05.1 Cuadro A

2. Casilla 1415=Casilla 0050 en S.05.1 Cuadro A



CUADRO E

| Tipo de interés nominal                    | Situación actual xx/xx/xxxx |      |                   |      | Situación cierre anual anterior<br>31/12/xxxx |      |                   |      | Situación inicial xx/xx/xxxx |      |                   |      |
|--------------------------------------------|-----------------------------|------|-------------------|------|-----------------------------------------------|------|-------------------|------|------------------------------|------|-------------------|------|
|                                            | Nº de activos vivos         |      | Importe pendiente |      | Nº de activos vivos                           |      | Importe pendiente |      | Nº de activos vivos          |      | Importe pendiente |      |
| Inferior al 1%                             | 1500                        |      | 1521              |      | 1542                                          |      | 1563              |      | 1584                         |      | 1605              |      |
| 1% - 1,49%                                 | 1501                        |      | 1522              |      | 1543                                          |      | 1564              |      | 1585                         |      | 1606              |      |
| 1,5% - 1,99%                               | 1502                        |      | 1523              |      | 1544                                          |      | 1565              |      | 1586                         |      | 1607              |      |
| 2% - 2,49%                                 | 1503                        |      | 1524              |      | 1545                                          |      | 1566              |      | 1587                         |      | 1608              |      |
| 2,5% - 2,99%                               | 1504                        |      | 1525              |      | 1546                                          |      | 1567              |      | 1588                         |      | 1609              |      |
| 3% - 3,49%                                 | 1505                        |      | 1526              |      | 1547                                          |      | 1568              |      | 1589                         |      | 1610              |      |
| 3,5% - 3,99%                               | 1506                        |      | 1527              |      | 1548                                          |      | 1569              |      | 1590                         |      | 1611              |      |
| 4% - 4,49%                                 | 1507                        |      | 1528              |      | 1549                                          |      | 1570              |      | 1591                         |      | 1612              |      |
| 4,5% - 4,99%                               | 1508                        |      | 1529              |      | 1550                                          |      | 1571              |      | 1592                         |      | 1613              |      |
| 5% - 5,49%                                 | 1509                        |      | 1530              |      | 1551                                          |      | 1572              |      | 1593                         |      | 1614              |      |
| 5,5% - 5,99%                               | 1510                        |      | 1531              |      | 1552                                          |      | 1573              |      | 1594                         |      | 1615              |      |
| 6% - 6,49%                                 | 1511                        |      | 1532              |      | 1553                                          |      | 1574              |      | 1595                         |      | 1616              |      |
| 6,5% - 6,99%                               | 1512                        |      | 1533              |      | 1554                                          |      | 1575              |      | 1596                         |      | 1617              |      |
| 7% - 7,49%                                 | 1513                        |      | 1534              |      | 1555                                          |      | 1576              |      | 1597                         |      | 1618              |      |
| 7,5% - 7,99%                               | 1514                        |      | 1535              |      | 1556                                          |      | 1577              |      | 1598                         |      | 1619              |      |
| 8% - 8,49%                                 | 1515                        |      | 1536              |      | 1557                                          |      | 1578              |      | 1599                         |      | 1620              |      |
| 8,5% - 8,99%                               | 1516                        |      | 1537              |      | 1558                                          |      | 1579              |      | 1600                         |      | 1621              |      |
| 9% - 9,49%                                 | 1517                        |      | 1538              |      | 1559                                          |      | 1580              |      | 1601                         |      | 1622              |      |
| 9,5% - 9,99%                               | 1518                        |      | 1539              |      | 1560                                          |      | 1581              |      | 1602                         |      | 1623              |      |
| Superior al 10%                            | 1519                        |      | 1540              |      | 1561                                          |      | 1582              |      | 1603                         |      | 1624              |      |
| <b>Total</b>                               | 1520                        | suma | 1541              | suma | 1562                                          | suma | 1583              | suma | 1604                         | suma | 1625              | suma |
| <b>Tipo de interés medio ponderado (%)</b> |                             |      | 9542              |      |                                               |      | 9584              |      |                              |      | 1626              |      |

## CUADRES:

1. Casilla 1520=Casilla 0021 en S.05.1 Cuadro A
2. Casilla 1541=Casilla 0050 en S.05.1 Cuadro A
3. Casilla 1562=Casilla 0080 en S.05.1 Cuadro A
4. Casilla 1583=Casilla 0110 en S.05.1 Cuadro A
5. Casilla 1604=Casilla 0140 en S.05.1 Cuadro A
6. Casilla 1625=Casilla 0170 en S.05.1 Cuadro A



CUADRO F

| Concentración                                         | Situación actual xx/xx/xxxx |  |      |  | Situación cierre anual anterior<br>31/12/xxxx |  |      |  | Situación inicial xx/xx/xxxx |  |      |  |
|-------------------------------------------------------|-----------------------------|--|------|--|-----------------------------------------------|--|------|--|------------------------------|--|------|--|
|                                                       | Porcentaje                  |  | CNAE |  | Porcentaje                                    |  | CNAE |  | Porcentaje                   |  | CNAE |  |
|                                                       | 2000<br>2010                |  | 2020 |  | 2030<br>2040                                  |  | 2050 |  | 2060<br>2070                 |  | 2080 |  |
| Diez primeros deudores/emisores con más concentración |                             |  |      |  |                                               |  |      |  |                              |  |      |  |
| Sector: (1)                                           |                             |  |      |  |                                               |  |      |  |                              |  |      |  |

(1) Indíquese denominación del sector con mayor concentración  
(2) Incluir código CNAE con dos niveles de agregación.



CUADRO G

| Divisa / Pasivos emitidos por el Fondo | Situación actual xx/xx/xxxx |      |                             |  |                            |      | Situación inicial xx/xx/xxxx |      |                             |  |                            |      |
|----------------------------------------|-----------------------------|------|-----------------------------|--|----------------------------|------|------------------------------|------|-----------------------------|--|----------------------------|------|
|                                        | Nº de pasivos emitidos      |      | Importe pendiente en Divisa |  | Importe pendiente en euros |      | Nº de pasivos emitidos       |      | Importe pendiente en Divisa |  | Importe pendiente en euros |      |
| Euro - EUR                             | 3000                        |      | 3060                        |  | 3110                       |      | 3170                         |      | 3230                        |  | 3250                       |      |
| EEUU Dólar - USD                       | 3010                        |      | 3070                        |  | 3120                       |      | 3180                         |      | 3230                        |  | 3260                       |      |
| Japón Yen - JPY                        | 3020                        |      | 3080                        |  | 3130                       |      | 3190                         |      | 3230                        |  | 3270                       |      |
| Reino Unido Libra - GBP                | 3030                        |      | 3090                        |  | 3140                       |      | 3200                         |      | 3230                        |  | 3280                       |      |
| Otras                                  | 3040                        |      |                             |  | 3150                       |      | 3210                         |      |                             |  | 3290                       |      |
| <b>Total</b>                           | 3050                        | suma |                             |  | 3160                       | suma | 3220                         | suma |                             |  | 3300                       | suma |

CONTROLES:

1. Casilla 3050=Casilla 0006 en S.05.2 Columna A
2. Casilla 3160=Casilla 8025 en S.05.2 Columna A
3. Casilla 8085=Casilla 3220 en S.05.2 Columna A
4. Casilla 8105=Casilla 3300 en S.05.2 Columna A