

BBVA RMBS 4 Fondo de Titulización de Activos

Emisión / Issue : Bonos Serie A1 / Series A1 Bonds
Código / Code ISIN : ES0314150006
Número / Number : 27.400 Bonos / Bonds
Divisa / Currency : EUR
Fecha / Date : 25.07.2012

												Amortización Bonos Series A1, A2, A3, B y C Series A1, A2, A3, B y C Bond Amortisation				
Fecha de Pago Payment Date	% Tipo Interés % Interest Rate	Cupón Coupon		Intereses Serie Series Interest			Principal Amortizado Principal Repaid			Saldo Principal Pendiente Outstanding Principal Balance			Principal Devengado Principal Due	Principal Amortizado Principal Repaid	Amortización de Principal devengado no satisfecha Principals amortisation accrued not paid	
		Bruto Gross	Neto Net	Pagados Paid	Impagados / Not Paid		Bono Bond	Serie Series	%	Bono Bond	Serie Series	%				
				Totales Totals	Recuperados Recovered	Actuales Actual										
TTALES Totals		7.949,76	6.494,97	217.823.305,58	0,00	0,00	0,00	100.000,00	2.740.000.000,00	100,00%	0,00	0,00	0,00%	2.916.988.656,00	2.740.000.000,00	0,00

SERIE AMORTIZADA AMORTISED SERIES

25.07.2012	0,911%	81,678394	64,525931	2.237.988,00	0,00	0,00	0,00	35.469,08	971.852.792,00	35,47%	0,00	0,00	0,00%	971.852.792,00	971.852.792,00	0,00
25.04.2012	1,348%	128,761874	101,721880	3.528.075,35	0,00	0,00	0,00	2.319,32	63.549.368,00	2,32%	35.469,08	971.852.792,00	35,47%	63.549.368,00	63.549.368,00	0,00
25.01.2012	1,765%	180,721723	142,770161	4.951.775,21	0,00	0,00	0,00	2.278,00	62.417.200,00	2,28%	37.788,40	1.035.402.160,00	37,79%	62.417.200,00	62.417.200,00	0,00
25.10.2011	1,788%	189,833231	153,764917	5.201.430,53	0,00	0,00	0,00	1.935,20	53.024.480,00	1,94%	40.066,40	1.097.819.360,00	40,07%	53.024.480,00	53.024.480,00	0,00
26.07.2011	1,523%	175,731959	142,342887	4.815.055,68	0,00	0,00	0,00	3.645,37	99.883.138,00	3,65%	42.001,60	1.150.843.840,00	42,00%	99.883.138,00	99.883.138,00	0,00
26.04.2011	1,205%	145,938347	118,210061	3.998.710,71	0,00	0,00	0,00	2.264,94	62.059.356,00	2,26%	45.646,97	1.250.726.978,00	45,65%	103.165.110,00	62.059.356,00	41.105.754,00
25.01.2011	1,205%	157,445158	127,530578	4.313.997,33	0,00	0,00	0,00	3.215,87	88.114.838,00	3,22%	47.911,91	1.312.786.334,00	47,91%	124.295.990,00	88.114.838,00	36.181.152,00
25.10.2010	1,064%	144,082961	116,707198	3.947.873,13	0,00	0,00	0,00	2.443,51	66.952.174,00	2,44%	51.127,78	1.400.901.172,00	51,13%	102.620.398,00	66.952.174,00	35.668.224,00
26.07.2010	0,824%	118,342123	95,857120	3.242.574,17	0,00	0,00	0,00	3.245,05	88.914.370,00	3,25%	53.571,29	1.467.853.346,00	53,57%	120.400.258,00	88.914.370,00	31.485.888,00
26.04.2010	0,852%	129,905318	105,223308	3.559.405,71	0,00	0,00	0,00	3.501,87	95.951.238,00	3,50%	56.816,34	1.556.767.716,00	56,82%	117.226.516,00	95.951.238,00	21.275.278,00
25.01.2010	0,913%	148,301909	120,124546	4.063.472,31	0,00	0,00	0,00	3.941,25	107.990.250,00	3,94%	60.318,21	1.652.718.954,00	60,32%	119.262.610,00	107.990.250,00	11.272.360,00
26.10.2009	1,107%	191,545501	157,067311	5.248.346,73	0,00	0,00	0,00	4.192,43	114.872.582,00	4,19%	64.259,46	1.760.709.204,00	64,26%	114.872.582,00	114.872.582,00	0,00
27.07.2009	1,586%	296,547675	243,169093	8.125.406,30	0,00	0,00	0,00	5.517,57	151.181.418,00	5,52%	68.451,89	1.875.581.786,00	68,45%	151.181.418,00	151.181.418,00	0,00
27.04.2009	2,434%	488,206369	400,329223	13.376.854,51	0,00	0,00	0,00	5.380,00	147.412.000,00	5,38%	73.969,46	2.026.763.204,00	73,97%	147.412.000,00	147.412.000,00	0,00
26.01.2009	5,101%	1.082,326303	887,507568	29.655.740,70	0,00	0,00	0,00	4.589,58	125.754.492,00	4,59%	79.349,46	2.174.175.204,00	79,35%	125.754.492,00	125.754.492,00	0,00
27.10.2008	5,143%	1.139,041979	934,014423	31.209.750,22	0,00	0,00	0,00	3.677,14	100.753.636,00	3,68%	83.939,04	2.299.929.696,00	83,94%	100.753.636,00	100.753.636,00	0,00
28.07.2008	5,009%	1.202,692139	986,207554	32.953.764,61	0,00	0,00	0,00	4.339,40	118.899.560,00	4,34%	87.616,18	2.400.683.332,00	87,62%	118.899.560,00	118.899.560,00	0,00
25.04.2008	4,468%	1.093,008271	896,266782	29.948.426,63	0,00	0,00	0,00	4.821,25	132.102.250,00	4,82%	91.955,58	2.519.582.892,00	91,96%	132.102.250,00	132.102.250,00	0,00
25.01.2008	4,813%	855,644444	701,628444	23.444.657,77	0,00	0,00	0,00	3.223,17	88.314.858,00	3,22%	96.776,83	2.651.685.142,00	96,78%	88.314.858,00	88.314.858,00	0,00
19.11.2007											100,00%	2.740.000.000,00	100,00%			

BBVA RMBS 4 Fondo de Titulación de Activos

Emisión / Issue : Bonos Serie A2 / Series A2 Bonds
Código / Code ISIN : ES0314150014
Número / Number : 9.600 Bonos / Bonds
Divisa / Currency : EUR
Fecha / Date : 25.07.2012

													Amortización Bonos Series A1, A2, A3, B y C Series A1, A2, A3, B y C Bond Amortisation			
Fecha de Pago Payment Date	% Tipo Interés % Interest Rate	Cupón Coupon		Intereses Serie Series Interest			Principal Amortizado Principal Repaid			Saldo Principal Pendiente Outstanding Principal Balance			Principal Devengado Principal Due	Principal Amortizado Principal Repaid	Amortización de Principal devengado no satisfecha Principals amortisation accrued not paid	
		Bruto Gross	Neto Net	Pagados Paid	Impagados / Not Paid		Bono Bond	Serie Series	%	Bono Bond	Serie Series	%				
		Totales Totals	Recuperados Recovered	Actuales Actual												
TOTALES Totals		10.905,29	8.884,93	104.690.800,00	0,00	0,00	0,00	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	0,00	0,00	0,00%	2.916.988.656,00	2.740.000.000,00	0,00

SERIE AMORTIZADA AMORTISED SERIES

25.07.2012	0,981%	247,975000	195,900250	2.380.560,00	0,00	0,00	0,00	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	0,00	0,00	0,00%	971.852.792,00	971.852.792,00	0,00
25.04.2012	1,418%	358,438889	283,166722	3.441.013,34	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	63.549.368,00	63.549.368,00	0,00
25.01.2012	1,835%	468,944444	370,466111	4.501.866,66	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	62.417.200,00	62.417.200,00	0,00
25.10.2011	1,858%	469,661111	380,425500	4.508.746,67	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	53.024.480,00	53.024.480,00	0,00
26.07.2011	1,593%	402,675000	326,166750	3.865.680,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	99.883.138,00	99.883.138,00	0,00
26.04.2011	1,275%	322,291667	261,056250	3.094.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	103.165.110,00	62.059.356,00	41.105.754,00
25.01.2011	1,275%	325,833333	263,925000	3.128.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	124.295.990,00	88.114.838,00	36.181.152,00
25.10.2010	1,134%	286,650000	232,186500	2.751.840,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	102.620.398,00	66.952.174,00	35.668.224,00
26.07.2010	0,894%	225,983333	183,046500	2.169.440,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	120.400.258,00	88.914.370,00	31.485.888,00
26.04.2010	0,922%	233,061111	188,779500	2.237.386,67	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	117.226.516,00	95.951.238,00	21.275.278,00
25.01.2010	0,983%	248,480556	201,269250	2.385.413,34	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	119.262.610,00	107.990.250,00	11.272.360,00
26.10.2009	1,177%	297,519444	243,965944	2.856.186,66	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	114.872.582,00	114.872.582,00	0,00
27.07.2009	1,656%	418,600000	343,252000	4.018.560,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	151.181.418,00	151.181.418,00	0,00
27.04.2009	2,504%	632,955556	519,023556	6.076.373,33	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	147.412.000,00	147.412.000,00	0,00
26.01.2009	5,171%	1.307,113889	1.071,833389	12.548.293,33	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	125.754.492,00	125.754.492,00	0,00
27.10.2008	5,213%	1.317,730556	1.080,539056	12.650.213,34	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	100.753.636,00	100.753.636,00	0,00
28.07.2008	5,079%	1.326,183333	1.087,470333	12.731.360,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	118.899.560,00	118.899.560,00	0,00
25.04.2008	4,538%	1.147,105556	940,626556	11.012.213,33	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	132.102.250,00	132.102.250,00	0,00
25.01.2008	4,883%	868,088889	711,832889	8.333.653,33	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	960.000.000,00	100,00%	88.314.858,00	88.314.858,00	0,00
19.11.2007											100.000,00	960.000.000,00	100,00%			

BBVA RMBS 4 Fondo de Titulización de Activos

Emisión / Issue : Bonos Serie A3 / Series A3 Bonds
Código / Code ISIN : ES0314150022
Número / Number : 10.505 Bonos / Bonds
Divisa / Currency : EUR
Fecha / Date : 25.07.2012

													Amortización Bonos Series A1, A2, A3, B y C			
													Series A1, A2, A3, B y C Bond Amortisation			
Fecha de Pago Payment Date	% Tipo Interés % Interest Rate	Cupón Coupon		Intereses Serie Series Interest			Principal Amortizado Principal Repaid			Saldo Principal Pendiente Outstanding Principal Balance			Principal Devengado Principal Due	Principal Amortizado Principal Repaid	Amortización de Principal devengado no satisfecha Principals amortisation accrued not paid	
		Bruto Gross	Neto Net	Pagados Paid	Impagados / Not Paid		Bono Bond	Serie Series	%	Bono Bond	Serie Series	%				
		Totales Totals	Recuperados Recovered	Actuales Actual												
TOTALES Totals		11.142,37	9.077,19	117.050.649,37	0,00	0,00	0,00	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	0,00	0,00	0,00%	2.916.988.656,00	2.740.000.000,00	0,00

SERIE AMORTIZADA AMORTISED SERIES

25.07.2012	1,031%	260,613889	205,884972	2.737.748,90	0,00	0,00	0,00	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	0,00	0,00	0,00%	971.852.792,00	971.852.792,00	0,00
25.04.2012	1,468%	371,077778	293,151445	3.898.172,06	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	63.549.368,00	63.549.368,00	0,00
25.01.2012	1,885%	481,722222	380,560555	5.060.491,94	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	62.417.200,00	62.417.200,00	0,00
25.10.2011	1,908%	482,300000	390,663000	5.066.561,50	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	53.024.480,00	53.024.480,00	0,00
26.07.2011	1,643%	415,313889	336,404250	4.362.872,40	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	99.883.138,00	99.883.138,00	0,00
26.04.2011	1,325%	334,930556	271,293750	3.518.445,49	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	103.165.110,00	62.059.356,00	41.105.754,00
25.01.2011	1,325%	338,611111	274,275000	3.557.109,72	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	124.295.990,00	88.114.838,00	36.181.152,00
25.10.2010	1,184%	299,288889	242,424000	3.144.029,78	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	102.620.398,00	66.952.174,00	35.668.224,00
26.07.2010	0,944%	238,622222	193,284000	2.506.726,44	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	120.400.258,00	88.914.370,00	31.485.888,00
26.04.2010	0,972%	245,700000	199,017000	2.581.078,50	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	117.226.516,00	95.951.238,00	21.275.278,00
25.01.2010	1,033%	261,119444	211,506750	2.743.059,76	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	119.262.610,00	107.990.250,00	11.272.360,00
26.10.2009	1,227%	310,158333	254,329833	3.258.213,29	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	114.872.582,00	114.872.582,00	0,00
27.07.2009	1,706%	431,238889	353,615889	4.530.164,53	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	151.181.418,00	151.181.418,00	0,00
27.04.2009	2,554%	645,594444	529,387444	6.781.969,63	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	147.412.000,00	147.412.000,00	0,00
26.01.2009	5,221%	1.319,752778	1.082,197278	13.864.002,93	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	125.754.492,00	125.754.492,00	0,00
27.10.2008	5,263%	1.330,369444	1.090,902944	13.975.531,01	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	100.753.636,00	100.753.636,00	0,00
28.07.2008	5,129%	1.339,238889	1.098,175889	14.068.704,53	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	118.899.560,00	118.899.560,00	0,00
25.04.2008	4,588%	1.159,744444	950,990444	12.183.115,39	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	132.102.250,00	132.102.250,00	0,00
25.01.2008	4,933%	876,977778	719,121778	9.212.651,56	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%	88.314.858,00	88.314.858,00	0,00
19.11.2007											100.000,00	1.050.500.000,00	100,00%			

BBVA RMBS 4 Fondo de Titulización de Activos

Emisión / Issue : Bonos Serie B / Series B Bonds
Código / Code ISIN : ES0314150030
Número / Number : 417 Bonos / Bonds
Divisa / Currency : EUR
Fecha / Date : 25.07.2012

													Amortización Bonos Series A1, A2, A3, B y C					
													Series A1, A2, A3, B y C Bond Amortisation					
Fecha de Pago Payment Date	% Tipo Interés % Interest Rate	Cupón Coupon		Intereses Serie Series Interest			Principal Amortizado Principal Repaid			Saldo Principal Pendiente Outstanding Principal Balance			Principal Devengado Principal Due	Principal Amortizado Principal Repaid	Amortización de Principal devengado no satisfecha Principals amortisation accrued not paid			
		Bruto Gross	Neto Net	Pagados Paid	Impagados / Not Paid			Bono Bond	Serie Series	%	Bono Bond	Serie Series				%		
				Totales Totals	Recuperados Recovered	Actuales Actual												
TOTALES Totals				13.513,21	10.999,73	5.635.007,87	0,00	0,00	0,00	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	0,00	0,00	0,00%	2.916.988.656,00	2.740.000.000,00	0,00

SERIE AMORTIZADA AMORTISED SERIES

Fecha de Pago Payment Date	% Tipo Interés % Interest Rate	Cupón Coupon	Cupón Coupon	Pagados Paid	Totales Totals	Recuperados Recovered	Actuales Actual	Bono Bond	Serie Series	%	Bono Bond	Serie Series	%	Principal Due	Principal Repaid	Principals amortisation accrued not paid
25.07.2012	1,531%	387,002778	305,732195	161.380,16	0,00	0,00	0,00	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	0,00	0,00	0,00%	971.852.792,00	971.852.792,00	0,00
25.04.2012	1,968%	497,466667	392,998667	207.443,60	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	63.549.368,00	63.549.368,00	0,00
25.01.2012	2,385%	609,500000	481,505000	254.161,50	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	62.417.200,00	62.417.200,00	0,00
25.10.2011	2,408%	608,688889	493,038000	253.823,27	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	53.024.480,00	53.024.480,00	0,00
26.07.2011	2,143%	541,702778	438,779250	225.890,06	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	99.883.138,00	99.883.138,00	0,00
26.04.2011	1,825%	461,319444	373,668750	192.370,21	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	103.165.110,00	62.059.356,00	41.105.754,00
25.01.2011	1,825%	466,388889	377,775000	194.484,17	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	124.295.990,00	88.114.838,00	36.181.152,00
25.10.2010	1,684%	425,677778	344,799000	177.507,63	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	102.620.398,00	66.952.174,00	35.668.224,00
26.07.2010	1,444%	365,011111	295,659000	152.209,63	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	120.400.258,00	88.914.370,00	31.485.888,00
26.04.2010	1,472%	372,088889	301,392000	155.161,07	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	117.226.516,00	95.951.238,00	21.275.278,00
25.01.2010	1,533%	387,508333	313,881750	161.590,97	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	119.262.610,00	107.990.250,00	11.272.360,00
26.10.2009	1,727%	436,547222	357,968722	182.040,19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	114.872.582,00	114.872.582,00	0,00
27.07.2009	2,206%	557,627778	457,254778	232.530,78	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	151.181.418,00	151.181.418,00	0,00
27.04.2009	3,054%	771,983333	633,026333	321.917,05	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	147.412.000,00	147.412.000,00	0,00
26.01.2009	5,721%	1.446,141667	1.185,836167	603.041,08	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	125.754.492,00	125.754.492,00	0,00
27.10.2008	5,763%	1.456,758333	1.194,541833	607.468,22	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	100.753.636,00	100.753.636,00	0,00
28.07.2008	5,629%	1.469,794444	1.205,231444	612.904,28	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	118.899.560,00	118.899.560,00	0,00
25.04.2008	5,088%	1.286,133333	1.054,629333	536.317,60	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	132.102.250,00	132.102.250,00	0,00
25.01.2008	5,433%	965,866667	792,010667	402.766,40	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	41.700.000,00	100,00%	88.314.858,00	88.314.858,00	0,00
19.11.2007											100.000,00	41.700.000,00	100,00%			

BBVA RMBS 4 Fondo de Titulación de Activos

Emisión / Issue : Bonos Serie C / Series C Bonds
Código / Code ISIN : ES0314150048
Número / Number : 1.078 Bonos / Bonds
Divisa / Currency : EUR
Fecha / Date : 25.07.2012

													Amortización Bonos Series A1, A2, A3, B y C			
													Series A1, A2, A3, B y C Bond Amortisation			
Fecha de Pago Payment Date	% Tipo Interés % Interest Rate	Cupón Coupon		Intereses Serie Series Interest			Principal Amortizado Principal Repaid			Saldo Principal Pendiente Outstanding Principal Balance			Principal Devengado Principal Due	Principal Amortizado Principal Repaid	Amortización de Principal devengado no satisfecha Principals amortisation accrued not paid	
		Bruto Gross	Neto Net	Pagados Paid	Impagados / Not Paid			Bono Bond	Serie Series	%	Bono Bond	Serie Series				%
				Totales Totals	Recuperados Recovered	Actuales Actual										
TOTALES Totals		14.935,71	12.153,25	16.100.693,58	0,00	0,00	0,00	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	0,00	0,00	0,00%	2.916.988.656,00	2.740.000.000,00	0,00

SERIE AMORTIZADA AMORTISED SERIES

25.07.2012	1,831%	462,836111	365,640528	498,937,33	0,00	0,00	0,00	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	0,00	0,00	0,00%	971.852.792,00	971.852.792,00	0,00
25.04.2012	2,268%	573,300000	452,907000	618.017,40	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	63.549.368,00	63.549.368,00	0,00
25.01.2012	2,685%	686,166667	542,071667	739.687,67	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	62.417.200,00	62.417.200,00	0,00
25.10.2011	2,708%	684,522222	554,463000	737.914,96	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	53.024.480,00	53.024.480,00	0,00
26.07.2011	2,443%	617,536111	500,204250	665.703,93	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	99.883.138,00	99.883.138,00	0,00
26.04.2011	2,125%	537,152778	435,093750	579.050,69	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	103.165.110,00	62.059.356,00	41.105.754,00
25.01.2011	2,125%	543,055556	439,875000	585.413,89	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	124.295.990,00	88.114.838,00	36.181.152,00
25.10.2010	1,984%	501,511111	406,224000	540.628,98	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	102.620.398,00	66.952.174,00	35.668.224,00
26.07.2010	1,744%	440,844444	357,084000	475.230,31	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	120.400.258,00	88.914.370,00	31.485.888,00
26.04.2010	1,772%	447,922222	362,817000	482.860,16	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	117.226.516,00	95.951.238,00	21.275.278,00
25.01.2010	1,833%	463,341667	375,306750	499.482,32	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	119.262.610,00	107.990.250,00	11.272.360,00
26.10.2009	2,027%	512,380556	420,152056	552.346,24	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	114.872.582,00	114.872.582,00	0,00
27.07.2009	2,506%	633,461111	519,438111	682.871,08	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	151.181.418,00	151.181.418,00	0,00
27.04.2009	3,354%	847,816667	695,209667	913.946,37	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	147.412.000,00	147.412.000,00	0,00
26.01.2009	6,021%	1.521,975000	1.248,019500	1.640.689,05	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	125.754.492,00	125.754.492,00	0,00
27.10.2008	6,063%	1.532,591667	1.256,725167	1.652.133,82	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	100.753.636,00	100.753.636,00	0,00
28.07.2008	5,929%	1.548,127778	1.269,464778	1.668.881,74	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	118.899.560,00	118.899.560,00	0,00
25.04.2008	5,388%	1.361,966667	1.116,812667	1.468.200,07	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	132.102.250,00	132.102.250,00	0,00
25.01.2008	5,733%	1.019,200000	835,744000	1.098.697,60	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	100.000,00	107.800.000,00	100,00%	88.314.858,00	88.314.858,00	0,00
19.11.2007											100.000,00	107.800.000,00	100,00%			