

GESTIÓN DE ACTIVOS TITULIZADOS

Grupo CAIXA CATALUNYA

Barcelona, 26 de Octubre de 2009

COMISIÓN NACIONAL DEL MERCADO DE VALORES

Passeig de Gràcia, 19

08007 Barcelona

Asunto: Hipocat 8 Fondo de Titulización de Activos

Con relación al fondo de referencia les adjuntamos la siguiente información periódica correspondiente al 15 de Septiembre de 2009, fecha de pago de intereses y de reembolso por amortización de principal de los Bonos Series A1, A2, B, C y D emitidos con cargo al Fondo.

- Estados de los Bonos de Titulización al 15/09/2009 (*en español y en inglés*):
 - Emisión de Bonos de la Serie A1 (ISIN: ES0345784005)
 - Emisión de Bonos de la Serie A2 (ISIN: ES0345784013)
 - Emisión de Bonos de la Serie B (ISIN: ES0345784021)
 - Emisión de Bonos de la Serie C (ISIN: ES0345784039)
 - Emisión de Bonos de la Serie D (ISIN: ES0345784047)
 - Vida media y amortización final calculadas con la hipótesis de mantenimiento de la tasa de amortización anticipada real experimentada por los Préstamos Hipotecarios Participados durante el último trimestre
- Estados de la cartera de Participaciones Hipotecarias al 31/08/2009:
 - Clasificación por los índices de referencia del tipo de interés.
 - Situación de impagados y fallidos: clasificación por tramos de antigüedad de la primera cuota vencida y no pagada de cada préstamo.
 - Situación de impagados y fallidos: clasificación por tramos de antigüedad de cada cuota vencida y no pagada de los préstamos.
 - Amortización anticipada y tasa de amortización anticipada real.
- Estado de origen y aplicación de los fondos disponibles correspondientes a la Fecha de Pago 15/09/2009 (*en español y en inglés*).

Atentamente:



Carles Fruns Moncunill

Director General

GESTIÓN DE ACTIVOS TITULIZADOS SGFT S.A.

Anexo: Documentación que se cita. (22 hojas)

Bonos Titulización de Activos SERIE A1

Número de Bonos: 2.500											PROMEMORIA		
Código ISIN: ES0345784005											Amortización Bonos		
Fecha Pago	% Tipo interés nominal	Cupón por bono		Intereses totales		Amortización por bono			Amortización total		Principal devengado amortización	Principal Amortizado	Saldo cta. deficiencia principal
		Bruto	Neto	Pagados	Impagados	Amortizado	Principal pendiente	% sobre emisión	Amortizado	principal pendiente			
15/06/2006	2,7410%	89,33 €	75,93 €	223.325,00 €	0,00	12.753,13 €	0,00 €	0,00%	31.882.825,00 €	0,00 €	31.882.825,00 €	31.882.825,00 €	0,00 €
15/03/2006	2,4960%	239,77 €	203,80 €	599.425,00 €	0,00	25.671,96 €	12.753,13 €	12,75%	64.179.900,00 €	31.882.825,00 €	64.179.900,00 €	64.179.900,00 €	0,00 €
15/12/2005	2,1760%	357,51 €	303,88 €	893.775,00 €	0,00	26.571,70 €	38.425,09 €	38,43%	66.429.250,00 €	96.062.725,00 €	66.429.250,00 €	66.429.250,00 €	0,00 €
15/09/2005	2,1730%	760,55 €	646,47 €	1.901.375,00 €	0,00	35.003,21 €	64.996,79 €	65,00%	87.508.025,00 €	162.491.975,00 €	87.508.025,00 €	87.508.025,00 €	0,00 €
12/05/2005							100.000,00 €			250.000.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos SERIE A2

Número de Bonos: 11.555											PROMEMORIA		
Código ISIN: ES0345784013											Amortización Bonos		
Fecha Pago	% Tipo interés nominal	Cupón por bono		Intereses totales		Amortización por bono			Amortización total		Principal devengado amortización	Principal Amortizado	Saldo cta. deficiencia principal
		Bruto	Neto	Pagados	Impagados	Amortizado	Principal pendiente	% sobre emisión	Amortizado	principal pendiente			
15/09/2009	1,4170%	219,39 €	179,90 €	2.535.051,45 €	0,00	2.022,74 €	58.562,56 €	58,56%	23.372.760,70 €	676.690.380,80 €	23.372.760,70 €	23.372.760,70 €	0,00 €
15/06/2009	1,7900%	288,32 €	236,42 €	3.331.537,60 €	0,00	3.136,03 €	60.585,30 €	60,59%	36.236.826,65 €	700.063.141,50 €	36.236.826,65 €	36.236.826,65 €	0,00 €
16/03/2009	3,4690%	575,40 €	471,83 €	6.648.747,00 €	0,00	1.896,82 €	63.721,33 €	63,72%	21.917.755,10 €	736.299.968,15 €	21.917.755,10 €	21.917.755,10 €	0,00 €
15/12/2008	5,0980%	868,46 €	712,14 €	10.035.055,30 €	0,00	1.774,61 €	65.618,15 €	65,62%	20.505.618,55 €	758.217.723,25 €	20.505.618,55 €	20.505.618,55 €	0,00 €
15/09/2008	5,0980%	893,68 €	732,82 €	10.326.472,40 €	0,00	1.956,70 €	67.392,76 €	67,39%	22.609.668,50 €	778.723.341,80 €	22.609.668,50 €	22.609.668,50 €	0,00 €
16/06/2008	4,7460%	859,88 €	705,10 €	9.935.913,40 €	0,00	2.326,04 €	69.349,46 €	69,35%	26.877.392,20 €	801.333.010,30 €	26.877.392,20 €	26.877.392,20 €	0,00 €
17/03/2008	5,0880%	947,30 €	776,79 €	10.946.051,50 €	0,00	1.979,63 €	71.675,50 €	71,68%	22.874.624,65 €	828.210.402,50 €	22.874.624,65 €	22.874.624,65 €	0,00 €
17/12/2007	4,8700%	937,60 €	768,83 €	10.833.968,00 €	0,00	2.509,06 €	73.655,13 €	73,66%	28.992.188,30 €	851.085.027,15 €	28.992.188,30 €	28.992.188,30 €	0,00 €
17/09/2007	4,2850%	884,99 €	725,69 €	10.226.059,45 €	0,00	2.933,14 €	76.164,19 €	76,16%	33.892.432,70 €	880.077.215,45 €	33.892.432,70 €	33.892.432,70 €	0,00 €
15/06/2007	4,0290%	856,31 €	702,17 €	9.894.662,05 €	0,00	4.069,02 €	79.097,33 €	79,10%	47.017.526,10 €	913.969.648,15 €	47.017.526,10 €	47.017.526,10 €	0,00 €
15/03/2007	3,8140%	834,07 €	683,94 €	9.637.678,85 €	0,00	4.308,67 €	83.166,35 €	83,17%	49.786.681,85 €	960.987.174,25 €	49.786.681,85 €	49.786.681,85 €	0,00 €
15/12/2006	3,4610%	874,86 €	743,63 €	10.109.007,30 €	0,00	12.524,98 €	87.475,02 €	87,48%	144.726.143,90 €	1.010.773.856,10 €	144.726.143,90 €	144.726.143,90 €	0,00 €
15/09/2006	3,0990%	791,97 €	673,17 €	9.151.213,35 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	1.155.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/06/2006	2,8410%	726,03 €	617,13 €	8.389.276,65 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	1.155.500.000,00 €	31.882.825,00 €	31.882.825,00 €	0,00 €
15/03/2006	2,5960%	649,00 €	551,65 €	7.499.195,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	1.155.500.000,00 €	64.179.900,00 €	64.179.900,00 €	0,00 €
15/12/2005	2,2760%	575,32 €	489,02 €	6.647.822,60 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	1.155.500.000,00 €	66.429.250,00 €	66.429.250,00 €	0,00 €
15/09/2005	2,2730%	795,55 €	676,22 €	9.192.580,25 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	1.155.500.000,00 €	87.508.025,00 €	87.508.025,00 €	0,00 €
12/05/2005							100.000,00 €			1.155.500.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos SERIE B

Número de Bonos: 262											PROMEMORIA		
Código ISIN: ES0345784021											Amortización Bonos		
Fecha Pago	% Tipo interés nominal	Cupón por bono		Intereses totales		Amortización por bono			Amortización total		Principal devengado amortización	Principal Amortizado	Saldo cta. deficiencia principal
		Bruto	Neto	Pagados	Impagados	Amortizado	Principal pendiente	% sobre emisión	Amortizado	principal pendiente			
15/09/2009	1,4370%	367,23 €	301,13 €	96.214,26 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	23.372.760,70 €	23.372.760,70 €	0,00 €
15/06/2009	1,8100%	457,53 €	375,17 €	119.872,86 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	36.236.826,65 €	36.236.826,65 €	0,00 €
16/03/2009	3,4890%	881,94 €	723,19 €	231.068,28 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	21.917.755,10 €	21.917.755,10 €	0,00 €
15/12/2008	5,1180%	1.293,72 €	1.060,85 €	338.954,64 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	20.505.618,55 €	20.505.618,55 €	0,00 €
15/09/2008	5,1180%	1.293,72 €	1.060,85 €	338.954,64 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	22.609.668,50 €	22.609.668,50 €	0,00 €
16/06/2008	4,7660%	1.204,74 €	987,89 €	315.641,88 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	26.877.392,20 €	26.877.392,20 €	0,00 €
17/03/2008	5,1080%	1.291,19 €	1.058,78 €	338.291,78 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	22.874.624,65 €	22.874.624,65 €	0,00 €
17/12/2007	4,8900%	1.236,08 €	1.013,59 €	323.852,96 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	28.992.188,30 €	28.992.188,30 €	0,00 €
17/09/2007	4,3050%	1.124,08 €	921,75 €	294.508,96 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	33.892.432,70 €	33.892.432,70 €	0,00 €
15/06/2007	4,0490%	1.034,74 €	848,49 €	271.101,88 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	47.017.526,10 €	47.017.526,10 €	0,00 €
15/03/2007	3,8340%	958,50 €	785,97 €	251.127,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	49.786.681,85 €	49.786.681,85 €	0,00 €
15/12/2006	3,4810%	879,92 €	747,93 €	230.539,04 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	144.726.143,90 €	144.726.143,90 €	0,00 €
15/09/2006	3,1190%	797,08 €	677,52 €	208.834,96 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/06/2006	2,8610%	731,14 €	621,47 €	191.558,68 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	31.882.825,00 €	31.882.825,00 €	0,00 €
15/03/2006	2,6160%	654,00 €	555,90 €	171.348,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	64.179.900,00 €	64.179.900,00 €	0,00 €
15/12/2005	2,2960%	580,38 €	493,32 €	152.059,56 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	66.429.250,00 €	66.429.250,00 €	0,00 €
15/09/2005	2,2930%	802,55 €	682,17 €	210.268,10 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	87.508.025,00 €	87.508.025,00 €	0,00 €
12/05/2005							100.000,00 €			26.200.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos SERIE C

Número de Bonos: 356											PROMEMORIA		
Código ISIN: ES0345784039											Amortización Bonos		
Fecha Pago	% Tipo interés nominal	Cupón por bono		Intereses totales		Amortización por bono			Amortización total		Principal devengado amortización	Principal Amortizado	Saldo cta. deficiencia principal
		Bruto	Neto	Pagados	Impagados	Amortizado	Principal pendiente	% sobre emisión	Amortizado	principal pendiente			
15/09/2009	1,5370%	392,79 €	322,09 €	139.833,24 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	23.372.760,70 €	23.372.760,70 €	0,00 €
15/06/2009	1,9100%	482,81 €	395,90 €	171.880,36 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	36.236.826,65 €	36.236.826,65 €	0,00 €
16/03/2009	3,5890%	907,22 €	743,92 €	322.970,32 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	21.917.755,10 €	21.917.755,10 €	0,00 €
15/12/2008	5,2180%	1.318,99 €	1.081,57 €	469.560,44 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	20.505.618,55 €	20.505.618,55 €	0,00 €
15/09/2008	5,2180%	1.318,99 €	1.081,57 €	469.560,44 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	22.609.668,50 €	22.609.668,50 €	0,00 €
16/06/2008	4,8660%	1.230,02 €	1.008,62 €	437.887,12 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	26.877.392,20 €	26.877.392,20 €	0,00 €
17/03/2008	5,2080%	1.316,47 €	1.079,51 €	468.663,32 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	22.874.624,65 €	22.874.624,65 €	0,00 €
17/12/2007	4,9900%	1.261,36 €	1.034,32 €	449.044,16 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	28.992.188,30 €	28.992.188,30 €	0,00 €
17/09/2007	4,4050%	1.150,19 €	943,16 €	409.467,64 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	33.892.432,70 €	33.892.432,70 €	0,00 €
15/06/2007	4,1490%	1.060,30 €	869,45 €	377.466,80 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	47.017.526,10 €	47.017.526,10 €	0,00 €
15/03/2007	3,9340%	983,50 €	806,47 €	350.126,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	49.786.681,85 €	49.786.681,85 €	0,00 €
15/12/2006	3,5810%	905,20 €	769,42 €	322.251,20 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	144.726.143,90 €	144.726.143,90 €	0,00 €
15/09/2006	3,2190%	822,63 €	699,24 €	292.856,28 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/06/2006	2,9610%	756,70 €	643,20 €	269.385,20 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	31.882.825,00 €	31.882.825,00 €	0,00 €
15/03/2006	2,7160%	679,00 €	577,15 €	241.724,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	64.179.900,00 €	64.179.900,00 €	0,00 €
15/12/2005	2,3960%	605,66 €	514,81 €	215.614,96 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	66.429.250,00 €	66.429.250,00 €	0,00 €
15/09/2005	2,3930%	837,55 €	711,92 €	298.167,80 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	87.508.025,00 €	87.508.025,00 €	0,00 €
12/05/2005							100.000,00 €			35.600.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos SERIE D

Número de Bonos: 327											PROMEMORIA		
Código ISIN: ES0345784047											Amortización Bonos		
Fecha Pago	% Tipo interés nominal	Cupón por bono		Intereses totales		Amortización por bono			Amortización total		Principal devengado amortización	Principal Amortizado	Saldo cta. deficiencia principal
		Bruto	Neto	Pagados	Impagados	Amortizado	Principal pendiente	% sobre emisión	Amortizado	principal pendiente			
15/09/2009	1,7370%	443,90 €	364,00 €	145.155,30 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	23.372.760,70 €	23.372.760,70 €	0,00 €
15/06/2009	2,1100%	533,36 €	437,36 €	174.408,72 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	36.236.826,65 €	36.236.826,65 €	0,00 €
16/03/2009	3,7890%	957,78 €	785,38 €	313.194,06 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	21.917.755,10 €	21.917.755,10 €	0,00 €
15/12/2008	5,4180%	1.369,55 €	1.123,03 €	447.842,85 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	20.505.618,55 €	20.505.618,55 €	0,00 €
15/09/2008	5,4180%	1.369,55 €	1.123,03 €	447.842,85 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	22.609.668,50 €	22.609.668,50 €	0,00 €
16/06/2008	5,0660%	1.280,57 €	1.050,07 €	418.746,39 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	26.877.392,20 €	26.877.392,20 €	0,00 €
17/03/2008	5,4080%	1.367,02 €	1.120,96 €	447.015,54 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	22.874.624,65 €	22.874.624,65 €	0,00 €
17/12/2007	5,1900%	1.311,92 €	1.075,77 €	428.997,84 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	28.992.188,30 €	28.992.188,30 €	0,00 €
17/09/2007	4,6050%	1.202,42 €	985,98 €	393.191,34 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	33.892.432,70 €	33.892.432,70 €	0,00 €
15/06/2007	4,3490%	1.111,41 €	911,36 €	363.431,07 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	47.017.526,10 €	47.017.526,10 €	0,00 €
15/03/2007	4,1340%	1.033,50 €	847,47 €	337.954,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	49.786.681,85 €	49.786.681,85 €	0,00 €
15/12/2006	3,7810%	955,75 €	812,39 €	312.530,25 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	144.726.143,90 €	144.726.143,90 €	0,00 €
15/09/2006	3,4190%	873,74 €	742,68 €	285.712,98 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/06/2006	3,1610%	807,81 €	686,64 €	264.153,87 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	31.882.825,00 €	31.882.825,00 €	0,00 €
15/03/2006	2,9160%	729,00 €	619,65 €	238.383,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	64.179.900,00 €	64.179.900,00 €	0,00 €
15/12/2005	2,5960%	656,21 €	557,78 €	214.580,67 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	66.429.250,00 €	66.429.250,00 €	0,00 €
15/09/2005	2,5930%	907,55 €	771,42 €	296.768,85 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	87.508.025,00 €	87.508.025,00 €	0,00 €
12/05/2005							100.000,00 €			32.700.000,00 €			

Mortgage Securitisation Bonds SERIE A1

Number of bonds: 2.500											EXPLANATORY MEMORANDUM		
ISIN number: ES0345784005											Amortisation Bonds		
Date of payment	% Nominal rate	Cupon per bond		Total interests		Amortisation per bond			Total amortisation		Principal accrued amortisation	Principal amortised	Recovery deficit account
		Gross	Net	Paid	Unpaid	Amortised	Principal outstanding	% of issue	Amortised	principal outstanding			
15/06/2006	2,7410%	89,33 €	75,93 €	223.325,00 €	0,00	12.753,13 €	0,00 €	0,00%	31.882.825,00 €	0,00 €	31.882.825,00 €	31.882.825,00 €	0,00 €
15/03/2006	2,4960%	239,77 €	203,80 €	599.425,00 €	0,00	25.671,96 €	12.753,13 €	12,75%	64.179.900,00 €	31.882.825,00 €	64.179.900,00 €	64.179.900,00 €	0,00 €
15/12/2005	2,1760%	357,51 €	303,88 €	893.775,00 €	0,00	26.571,70 €	38.425,09 €	38,43%	66.429.250,00 €	96.062.725,00 €	66.429.250,00 €	66.429.250,00 €	0,00 €
15/09/2005	2,1730%	760,55 €	646,47 €	1.901.375,00 €	0,00	35.003,21 €	64.996,79 €	65,00%	87.508.025,00 €	162.491.975,00 €	87.508.025,00 €	87.508.025,00 €	0,00 €
12/05/2005							100.000,00 €			250.000.000,00 €			

Mortgage Securitisation Bonds SERIE A2

Number of bonds: 11.555											EXPLANATORY MEMORANDUM		
ISIN number: ES0345784013											Amortisation Bonds		
Date of payment	% Nominal rate	Cupon per bond		Total interests		Amortisation per bond			Total amortisation		Principal accrued amortisation	Principal amortised	Recovery deficit account
		Gross	Net	Paid	Unpaid	Amortised	Principal outstanding	% of issue	Amortised	principal outstanding			
15/09/2009	1,4170%	219,39 €	179,90 €	2.535.051,45 €	0,00	2.022,74 €	58.562,56 €	58,56%	23.372.760,70 €	676.690.380,80 €	23.372.760,70 €	23.372.760,70 €	0,00 €
15/06/2009	1,7900%	288,32 €	236,42 €	3.331.537,60 €	0,00	3.136,03 €	60.585,30 €	60,59%	36.236.826,65 €	700.063.141,50 €	36.236.826,65 €	36.236.826,65 €	0,00 €
16/03/2009	3,4690%	575,40 €	471,83 €	6.648.747,00 €	0,00	1.896,82 €	63.721,33 €	63,72%	21.917.755,10 €	736.299.968,15 €	21.917.755,10 €	21.917.755,10 €	0,00 €
15/12/2008	5,0980%	868,46 €	712,14 €	10.035.055,30 €	0,00	1.774,61 €	65.618,15 €	65,62%	20.505.618,55 €	758.217.723,25 €	20.505.618,55 €	20.505.618,55 €	0,00 €
15/09/2008	5,0980%	893,68 €	732,82 €	10.326.472,40 €	0,00	1.956,70 €	67.392,76 €	67,39%	22.609.668,50 €	778.723.341,80 €	22.609.668,50 €	22.609.668,50 €	0,00 €
16/06/2008	4,7460%	859,88 €	705,10 €	9.935.913,40 €	0,00	2.326,04 €	69.349,46 €	69,35%	26.877.392,20 €	801.333.010,30 €	26.877.392,20 €	26.877.392,20 €	0,00 €
17/03/2008	5,0880%	947,30 €	776,79 €	10.946.051,50 €	0,00	1.979,63 €	71.675,50 €	71,68%	22.874.624,65 €	828.210.402,50 €	22.874.624,65 €	22.874.624,65 €	0,00 €
17/12/2007	4,8700%	937,60 €	768,83 €	10.833.968,00 €	0,00	2.509,06 €	73.655,13 €	73,66%	28.992.188,30 €	851.085.027,15 €	28.992.188,30 €	28.992.188,30 €	0,00 €
17/09/2007	4,2850%	884,99 €	725,69 €	10.226.059,45 €	0,00	2.933,14 €	76.164,19 €	76,16%	33.892.432,70 €	880.077.215,45 €	33.892.432,70 €	33.892.432,70 €	0,00 €
15/06/2007	4,0290%	856,31 €	702,17 €	9.894.662,05 €	0,00	4.069,02 €	79.097,33 €	79,10%	47.017.526,10 €	913.969.648,15 €	47.017.526,10 €	47.017.526,10 €	0,00 €
15/03/2007	3,8140%	834,07 €	683,94 €	9.637.678,85 €	0,00	4.308,67 €	83.166,35 €	83,17%	49.786.681,85 €	960.987.174,25 €	49.786.681,85 €	49.786.681,85 €	0,00 €
15/12/2006	3,4610%	874,86 €	743,63 €	10.109.007,30 €	0,00	12.524,98 €	87.475,02 €	87,48%	144.726.143,90 €	1.010.773.856,10 €	144.726.143,90 €	144.726.143,90 €	0,00 €
15/09/2006	3,0990%	791,97 €	673,17 €	9.151.213,35 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	1.155.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/06/2006	2,8410%	726,03 €	617,13 €	8.389.276,65 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	1.155.500.000,00 €	31.882.825,00 €	31.882.825,00 €	0,00 €
15/03/2006	2,5960%	649,00 €	551,65 €	7.499.195,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	1.155.500.000,00 €	64.179.900,00 €	64.179.900,00 €	0,00 €
15/12/2005	2,2760%	575,32 €	489,02 €	6.647.822,60 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	1.155.500.000,00 €	66.429.250,00 €	66.429.250,00 €	0,00 €
15/09/2005	2,2730%	795,55 €	676,22 €	9.192.580,25 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	1.155.500.000,00 €	87.508.025,00 €	87.508.025,00 €	0,00 €
12/05/2005							100.000,00 €			1.155.500.000,00 €			

Mortgage Securitisation Bonds SERIE B

Number of bonds: 262											EXPLANATORY MEMORANDUM		
ISIN number: ES0345784021											Amortisation Bonds		
Date of payment	% Nominal rate	Cupon per bond		Total interests		Amortisation per bond			Total amortisation		Principal accrued amortisation	Principal amortised	Recovery deficit account
		Gross	Net	Paid	Unpaid	Amortised	Principal outstanding	% of issue	Amortised	principal outstanding			
15/09/2009	1,4370%	367,23 €	301,13 €	96.214,26 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	23.372.760,70 €	23.372.760,70 €	0,00 €
15/06/2009	1,8100%	457,53 €	375,17 €	119.872,86 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	36.236.826,65 €	36.236.826,65 €	0,00 €
16/03/2009	3,4890%	881,94 €	723,19 €	231.068,28 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	21.917.755,10 €	21.917.755,10 €	0,00 €
15/12/2008	5,1180%	1.293,72 €	1.060,85 €	338.954,64 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	20.505.618,55 €	20.505.618,55 €	0,00 €
15/09/2008	5,1180%	1.293,72 €	1.060,85 €	338.954,64 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	22.609.668,50 €	22.609.668,50 €	0,00 €
16/06/2008	4,7660%	1.204,74 €	987,89 €	315.641,88 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	26.877.392,20 €	26.877.392,20 €	0,00 €
17/03/2008	5,1080%	1.291,19 €	1.058,78 €	338.291,78 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	22.874.624,65 €	22.874.624,65 €	0,00 €
17/12/2007	4,8900%	1.236,08 €	1.013,59 €	323.852,96 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	28.992.188,30 €	28.992.188,30 €	0,00 €
17/09/2007	4,3050%	1.124,08 €	921,75 €	294.508,96 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	33.892.432,70 €	33.892.432,70 €	0,00 €
15/06/2007	4,0490%	1.034,74 €	848,49 €	271.101,88 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	47.017.526,10 €	47.017.526,10 €	0,00 €
15/03/2007	3,8340%	958,50 €	785,97 €	251.127,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	49.786.681,85 €	49.786.681,85 €	0,00 €
15/12/2006	3,4810%	879,92 €	747,93 €	230.539,04 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	144.726.143,90 €	144.726.143,90 €	0,00 €
15/09/2006	3,1190%	797,08 €	677,52 €	208.834,96 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/06/2006	2,8610%	731,14 €	621,47 €	191.558,68 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	31.882.825,00 €	31.882.825,00 €	0,00 €
15/03/2006	2,6160%	654,00 €	555,90 €	171.348,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	64.179.900,00 €	64.179.900,00 €	0,00 €
15/12/2005	2,2960%	580,38 €	493,32 €	152.059,56 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	66.429.250,00 €	66.429.250,00 €	0,00 €
15/09/2005	2,2930%	802,55 €	682,17 €	210.268,10 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	26.200.000,00 €	87.508.025,00 €	87.508.025,00 €	0,00 €
12/05/2005							100.000,00 €			26.200.000,00 €			

Mortgage Securitisation Bonds SERIE C

Number of bonds: 356											EXPLANATORY MEMORANDUM		
ISIN number: ES0345784039											Amortisation Bonds		
Date of payment	% Nominal rate	Cupon per bond		Total interests		Amortisation per bond			Total amortisation		Principal accrued amortisation	Principal amortised	Recovery deficit account
		Gross	Net	Paid	Unpaid	Amortised	Principal outstanding	% of issue	Amortised	principal outstanding			
15/09/2009	1,5370%	392,79 €	322,09 €	139.833,24 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	23.372.760,70 €	23.372.760,70 €	0,00 €
15/06/2009	1,9100%	482,81 €	395,90 €	171.880,36 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	36.236.826,65 €	36.236.826,65 €	0,00 €
16/03/2009	3,5890%	907,22 €	743,92 €	322.970,32 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	21.917.755,10 €	21.917.755,10 €	0,00 €
15/12/2008	5,2180%	1.318,99 €	1.081,57 €	469.560,44 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	20.505.618,55 €	20.505.618,55 €	0,00 €
15/09/2008	5,2180%	1.318,99 €	1.081,57 €	469.560,44 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	22.609.668,50 €	22.609.668,50 €	0,00 €
16/06/2008	4,8660%	1.230,02 €	1.008,62 €	437.887,12 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	26.877.392,20 €	26.877.392,20 €	0,00 €
17/03/2008	5,2080%	1.316,47 €	1.079,51 €	468.663,32 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	22.874.624,65 €	22.874.624,65 €	0,00 €
17/12/2007	4,9900%	1.261,36 €	1.034,32 €	449.044,16 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	28.992.188,30 €	28.992.188,30 €	0,00 €
17/09/2007	4,4050%	1.150,19 €	943,16 €	409.467,64 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	33.892.432,70 €	33.892.432,70 €	0,00 €
15/06/2007	4,1490%	1.060,30 €	869,45 €	377.466,80 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	47.017.526,10 €	47.017.526,10 €	0,00 €
15/03/2007	3,9340%	983,50 €	806,47 €	350.126,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	49.786.681,85 €	49.786.681,85 €	0,00 €
15/12/2006	3,5810%	905,20 €	769,42 €	322.251,20 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	144.726.143,90 €	144.726.143,90 €	0,00 €
15/09/2006	3,2190%	822,63 €	699,24 €	292.856,28 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/06/2006	2,9610%	756,70 €	643,20 €	269.385,20 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	31.882.825,00 €	31.882.825,00 €	0,00 €
15/03/2006	2,7160%	679,00 €	577,15 €	241.724,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	64.179.900,00 €	64.179.900,00 €	0,00 €
15/12/2005	2,3960%	605,66 €	514,81 €	215.614,96 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	66.429.250,00 €	66.429.250,00 €	0,00 €
15/09/2005	2,3930%	837,55 €	711,92 €	298.167,80 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.600.000,00 €	87.508.025,00 €	87.508.025,00 €	0,00 €
12/05/2005							100.000,00 €			35.600.000,00 €			

Mortgage Securitisation Bonds SERIE D

Number of bonds: 327											EXPLANATORY MEMORANDUM		
ISIN number: ES0345784047											Amortisation Bonds		
Date of payment	% Nominal rate	Cupon per bond		Total interests		Amortisation per bond			Total amortisation		Principal accrued amortisation	Principal amortised	Recovery deficit account
		Gross	Net	Paid	Unpaid	Amortised	Principal outstanding	% of issue	Amortised	principal outstanding			
15/09/2009	1,7370%	443,90 €	364,00 €	145.155,30 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	23.372.760,70 €	23.372.760,70 €	0,00 €
15/06/2009	2,1100%	533,36 €	437,36 €	174.408,72 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	36.236.826,65 €	36.236.826,65 €	0,00 €
16/03/2009	3,7890%	957,78 €	785,38 €	313.194,06 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	21.917.755,10 €	21.917.755,10 €	0,00 €
15/12/2008	5,4180%	1.369,55 €	1.123,03 €	447.842,85 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	20.505.618,55 €	20.505.618,55 €	0,00 €
15/09/2008	5,4180%	1.369,55 €	1.123,03 €	447.842,85 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	22.609.668,50 €	22.609.668,50 €	0,00 €
16/06/2008	5,0660%	1.280,57 €	1.050,07 €	418.746,39 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	26.877.392,20 €	26.877.392,20 €	0,00 €
17/03/2008	5,4080%	1.367,02 €	1.120,96 €	447.015,54 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	22.874.624,65 €	22.874.624,65 €	0,00 €
17/12/2007	5,1900%	1.311,92 €	1.075,77 €	428.997,84 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	28.992.188,30 €	28.992.188,30 €	0,00 €
17/09/2007	4,6050%	1.202,42 €	985,98 €	393.191,34 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	33.892.432,70 €	33.892.432,70 €	0,00 €
15/06/2007	4,3490%	1.111,41 €	911,36 €	363.431,07 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	47.017.526,10 €	47.017.526,10 €	0,00 €
15/03/2007	4,1340%	1.033,50 €	847,47 €	337.954,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	49.786.681,85 €	49.786.681,85 €	0,00 €
15/12/2006	3,7810%	955,75 €	812,39 €	312.530,25 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	144.726.143,90 €	144.726.143,90 €	0,00 €
15/09/2006	3,4190%	873,74 €	742,68 €	285.712,98 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/06/2006	3,1610%	807,81 €	686,64 €	264.153,87 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	31.882.825,00 €	31.882.825,00 €	0,00 €
15/03/2006	2,9160%	729,00 €	619,65 €	238.383,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	64.179.900,00 €	64.179.900,00 €	0,00 €
15/12/2005	2,5960%	656,21 €	557,78 €	214.580,67 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	66.429.250,00 €	66.429.250,00 €	0,00 €
15/09/2005	2,5930%	907,55 €	771,42 €	296.768,85 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	32.700.000,00 €	87.508.025,00 €	87.508.025,00 €	0,00 €
12/05/2005							100.000,00 €			32.700.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos al día 31/08/2009

Vida media y amortización final estimados según diferentes tasas constantes de amortización anticipada de cada trimestre

TASA AMORTIZACIÓN ANTICIPADA		INICIAL	28/02/2009	31/05/2009	31/08/2009
% mensual constante		1,249%	0,974%	0,977%	0,952%
% anual constante		14,000%	11,078%	11,113%	10,848%
BONOS SERIE A1 (ISIN: ES0345784005)					
Sin ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾					
Vida Media	Años	0,65	-	-	-
	Fecha	04/01/2006	-	-	-
Amortización Final	Años	1,09	-	-	-
	Fecha	15/06/2006	-	-	-
Con ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾					
Vida Media	Años	0,67	-	-	-
	Fecha	11/01/2006	-	-	-
Amortización Final	Años	1,09	-	-	-
	Fecha	15/06/2006	-	-	-
BONOS SERIE A2 (ISIN: ES0345784013)					
Sin ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾					
Vida Media	Años	5,82	6,88	6,84	6,96
	Fecha	09/03/2011	28/03/2012	14/03/2012	27/04/2012
Amortización Final	Años	20,35	22,59	12,59	22,84
	Fecha	15/09/2025	15/12/2027	15/12/2017	15/03/2028
Con ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾					
Vida Media	Años	5,68	6,53	6,50	6,62
	Fecha	15/01/2011	22/11/2011	11/11/2011	24/12/2011
Amortización Final	Años	12,34	14,1	14,1	14,35
	Fecha	14/09/2017	17/06/2019	17/06/2019	16/09/2019
BONOS SERIE B (ISIN: ES0345784021)					
Sin ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾					
Vida Media	Años	10,01	11,54	11,76	11,82
	Fecha	15/05/2015	24/11/2016	13/02/2017	07/03/2017
Amortización Final	Años	21,35	23,84	23,59	23,84
	Fecha	15/09/2026	15/03/2029	15/12/2028	15/03/2029
Con ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾					
Vida Media	Años	8,33	9,64	9,82	9,92
	Fecha	09/09/2013	01/01/2015	07/03/2015	13/04/2015
Amortización Final	Años	12,34	14,1	14,1	14,35
	Fecha	14/09/2017	17/06/2019	17/06/2019	16/09/2019
BONOS SERIE C (ISIN: ES0345784039)					
Sin ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾					
Vida Media	Años	10,34	11,83	12,07	12,12
	Fecha	15/09/2015	10/03/2017	06/06/2017	24/06/2017
Amortización Final	Años	23,60	25,6	25,59	25,85
	Fecha	16/12/2028	16/12/2030	15/12/2030	17/03/2031
Con ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾					
Vida Media	Años	8,33	9,64	9,82	9,92
	Fecha	09/09/2013	01/01/2015	07/03/2015	13/04/2015
Amortización Final	Años	12,34	14,1	14,1	14,35
	Fecha	14/09/2017	17/06/2019	17/06/2019	16/09/2019
BONOS SERIE D (ISIN: ES0345784047)					
Sin ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾					
Vida Media	Años	11,02	12,36	12,62	12,64
	Fecha	19/05/2016	20/09/2017	24/12/2017	31/12/2017
Amortización Final	Años	29,84	29,84	29,84	29,84
	Fecha	16/03/2035	15/03/2035	15/03/2035	15/03/2035
Con ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾					
Vida Media	Años	8,33	9,64	9,82	9,92
	Fecha	09/09/2013	01/01/2015	07/03/2015	13/04/2015
Amortización Final	Años	12,34	14,1	14,1	14,35
	Fecha	14/09/2017	17/06/2019	17/06/2019	16/09/2019

Hipótesis de morosidad de fallidos de la cartera de Participaciones Hipotecarias: 0% e introducción de una curva de ETTI (31/08/09)

(1) Amortización a opción de la Sociedad Gestora, cuando el importe del principal pendiente de amortización de las Participaciones Hipotecarias sea inferior al 10% inicial

Mortgage Securitisation Bonds at 31/08/2009

Estimated Average Life and Final Repayment of Bonds according to quarterly rates of early repayment

RATE OF EARLY REDEMPTION		INITIAL	28/02/2009	31/05/2009	31/08/2009
% constant monthly		1,237%	0,974%	0,977%	0,952%
% constant annual		13,878%	11,078%	11,113%	10,848%
CLASS A1 BONDS (ISIN: ES0345784005)					
Without optional repayment ⁽¹⁾					
Average Life	Years	0,65	-	-	-
	Date	04/01/2006	-	-	-
Final Repayment	Years	1,09	-	-	-
	Date	15/06/2006	-	-	-
With optional repayment ⁽¹⁾					
Average Life	Years	0,65	-	-	-
	Date	04/01/2006	-	-	-
Final Repayment	Years	1,09	-	-	-
	Date	15/06/2006	-	-	-
CLASS A2 BONDS (ISIN: ES0345784013)					
Without optional repayment ⁽¹⁾					
Average Life	Years	5,84	6,88	6,84	6,96
	Date	15/03/2011	28/03/2012	14/03/2012	27/04/2012
Final Repayment	Years	20,1	22,59	12,59	22,84
	Date	16/06/2025	15/12/2027	15/12/2017	15/03/2028
With optional repayment ⁽¹⁾					
Average Life	Years	5,53	6,53	6,50	6,62
	Date	21/11/2010	22/11/2011	11/11/2011	24/12/2011
Final Repayment	Years	12,09	14,1	14,1	14,35
	Date	15/06/2017	17/06/2019	17/06/2019	16/09/2019
CLASS B BONDS (ISIN: ES0345784021)					
Without optional repayment ⁽¹⁾					
Average Life	Years	10,26	11,54	11,76	11,82
	Date	15/08/2015	24/11/2016	13/02/2017	07/03/2017
Final Repayment	Years	21,34	23,84	23,59	23,84
	Date	15/09/2026	15/03/2029	15/12/2028	15/03/2029
With optional repayment ⁽¹⁾					
Average Life	Years	8,37	9,64	9,82	9,92
	Date	24/09/2013	01/01/2015	07/03/2015	13/04/2015
Final Repayment	Years	12,09	14,1	14,1	14,35
	Date	15/06/2017	17/06/2019	17/06/2019	16/09/2019
CLASS C BONDS (ISIN: ES0345784039)					
Without optional repayment ⁽¹⁾					
Average Life	Years	10,62	11,83	12,07	12,12
	Date	24/12/2015	10/03/2017	06/06/2017	24/06/2017
Final Repayment	Years	23,59	25,6	25,59	25,85
	Date	15/12/2028	16/12/2030	15/12/2030	17/03/2031
With optional repayment ⁽¹⁾					
Average Life	Years	8,37	9,64	9,82	9,92
	Date	24/09/2013	01/01/2015	07/03/2015	13/04/2015
Final Repayment	Years	12,09	14,1	14,1	14,35
	Date	15/06/2017	17/06/2019	17/06/2019	16/09/2019
CLASS D BONDS (ISIN: ES0345784047)					
Without optional repayment ⁽¹⁾					
Average Life	Years	11,35	12,36	12,62	12,64
	Date	16/09/2016	20/09/2017	24/12/2017	31/12/2017
Final Repayment	Years	29,84	29,84	29,84	29,84
	Date	15/03/2035	15/03/2035	15/03/2035	15/03/2035
With optional repayment ⁽¹⁾					
Average Life	Years	8,37	9,64	9,82	9,92
	Date	24/09/2013	01/01/2015	07/03/2015	13/04/2015
Final Repayment	Years	12,09	14,1	14,1	14,35
	Date	15/06/2017	17/06/2019	17/06/2019	16/09/2019

Hypotesis of bad defaulter of Participations Portfolio: 0% and ETTI (Interest Rate Temporary Structure) at 31/08/2009

(1) Amortisation at the Gestora's discretion, when principal outstanding balance of Participations is less than 10% of initial amount.

Cartera por índices a 31/08/2009

Situación: Regular
Incluir en WriteOff: No
Cedente: 2013 Caixa d'Estalvis de Catalunya

Índice (1)		Número PH	%	Principal pendiente	%	Tipo nominal	Margen s/ Referencia	Principal/ Tasación	Vida residual	
									Meses	Fecha
Índice	CECA Tipo Activo CECA	40	0,427213%	913.917,84	0,119602%	6,091942%	0,300255	39,792236	115,859288	27/04/2019
Índice	ER1A Euribor 1 año	3.607	38,523977%	379.883.743,83	49,714250%	4,110658%	0,855543	65,340650	263,089101	04/08/2031
Índice	IRPC Préstamos Hipotecarios Cajas	368	3,930364%	13.286.619,01	1,738780%	5,711114%	0,547703	49,940298	152,391872	13/05/2022
Índice	MB1A Mibor 1 Año	51	0,544697%	2.176.847,07	0,284877%	3,949390%	0,967201	43,760629	136,189548	05/01/2021
Índice	TAE1 Préstamos Hipotecarios Cajas TAE	5.297	56,573748%	367.873.394,47	48,142491%	5,274950%	0,197197	64,732330	242,497411	15/11/2029
Total	Caixa d'Estalvis de Catalunya	9.363	100%	764.134.522,22	100%	4,700915%	0,532900	64,687979	250,713370	23/07/2030
	Total cartera	9.363	100%	764.134.522,22	100%					
			<i>Media ponderada:</i>			4,700915	0,532900	64,687979	250,713370	23/07/2030
			<i>Media simple:</i>	81.612,15		4,886354	0,486436	54,506316	216,930106	29/09/2027
			<i>Mínimo:</i>	198,95		1,694000	-0,150000	0,091805	0,985626	30/09/2009
			<i>Máximo:</i>	416.746,77		7,170000	4,350000	99,378723	304,000000	31/12/2034

Tipos de Interés, Margen, Límites, Principal/Tasación y Vida Residual, son media ponderadas por el Principal Pendiente

Índice (1)		Número PH	%	Principal pendiente	%	Tipo nominal	Margen s/ Referencia	Principal/ Tasación	Vida residual	
									Meses	Fecha
Índice ER1A	Euribor 1 año	22	34,920635%	2.545.498,26	37,727667%	5,346723%	1,100419	77,134280	282,075937	04/03/2033
Índice IRPC	Préstamos Hipotecarios Cajas	1	1,587302%	38.550,50	0,571370%	6,910000%	0,750000	45,672625	101,026694	31/01/2018
Índice MB1A	Mibor 1 Año	1	1,587302%	19.195,72	0,284506%	3,134000%	1,000000	48,167629	115,942505	30/04/2019
Índice TAE1	Préstamos Hipotecarios Cajas TAE	39	61,904762%	4.143.788,82	61,416457%	5,218412%	0,220634	81,348920	274,985616	31/07/2032
Total	Caixa d'Estalvis de Catalunya	63	100%	6.747.033,30	100%	5,270555%	0,557799	79,460588	276,214193	06/09/2032
Total cartera		63	100%	6.747.033,30	100%					
<i>Media ponderada:</i>						5,270555	0,557799	79,460588	276,214193	06/09/2032
<i>Media simple:</i>				107.095,77		5,193587	0,563492	74,144419	257,470617	14/02/2031
<i>Mínimo:</i>				19.195,72		2,394000	0,000000	25,297072	56,969199	31/05/2014
<i>Máximo:</i>				236.804,19		6,993000	1,600000	97,602464	302,981520	30/11/2034

Tipos de Interés, Margen, Límites, Principal/Tasación y Vida Residual, son media ponderadas por el Principal Pendiente

Impagados desde primera cuota vencida a 31/08/2009

Situación: Regular
Incluir en WriteOff: No
Cedente: 2013 Caixa d'Estalvis de Catalunya

Antigüedad de la deuda	PH's	Deuda vencida				Deuda pendiente vencer		Deuda total			Valor garantía	Deuda/Tasación	
		Principal	Intereses	Total	% Total	Principal	% Principal	Principal	% Deuda	Total deuda		s/Principal	s/Total
Caixa d'Estalvis de Catalunya													
Hasta 1 Mes	221	40.412,39	53.001,20	93.413,59	21,11%	21.728.434,94	51,69%	21.768.847,33	51,60%	21.821.848,53	32.018.532,74	67,9883%	68,1538%
De 1 a 2 Meses	108	46.209,06	82.074,84	128.283,90	28,99%	10.945.069,35	26,04%	10.991.278,41	26,05%	11.073.353,25	16.203.858,04	67,8312%	68,3378%
De 2 a 3 Meses	43	25.291,22	56.324,22	81.615,44	18,45%	4.765.359,13	11,34%	4.790.650,35	11,36%	4.846.974,57	6.282.711,66	76,2513%	77,1478%
De 3 a 6 Meses	34	33.434,26	84.275,11	117.709,37	26,60%	4.126.809,84	9,82%	4.160.244,10	9,86%	4.244.519,21	5.579.269,87	74,5661%	76,0766%
De 6 a 12 Meses	5	5.323,30	16.099,27	21.422,57	4,84%	471.456,19	1,12%	476.779,49	1,13%	492.878,76	576.025,30	82,7706%	85,5655%
Total cedente:	411	150.670,23	291.774,64	442.444,87	100%	42.037.129,45	100%	42.187.799,68	100%	42.479.574,32	60.660.397,61	69,5475%	70,0285%
Total listado:	411	150.670,23	291.774,64	442.444,87	100%	42.037.129,45	100%	42.187.799,68	100%	42.479.574,32	60.660.397,61	69,5475%	70,0285%

Impagados desde primera cuota vencida a 31/08/2009

Situación: Irregular
Incluir en WriteOff: No
Cedente: 2013 Caixa d'Estalvis de Catalunya

Antigüedad de la deuda	PH's	Deuda vencida				Deuda pendiente vencer		Deuda total			Valor garantía	Deuda/Tasación	
		Principal	Intereses	Total	% Total	Principal	% Principal	Principal	% Deuda	Total deuda		s/Principal	s/Total
Caixa d'Estalvis de Catalunya													
Hasta 1 Mes	3	0,00	0,00	0,00	0,00%	252.044,89	3,74%	252.044,89	3,69%	252.044,89	477.644,94	52,7683%	52,7683%
De 3 a 6 Meses	15	12.242,42	33.043,50	45.285,92	15,14%	1.639.152,85	24,29%	1.651.395,27	24,18%	1.684.438,77	2.059.408,42	80,1878%	81,7924%
De 6 a 12 Meses	28	37.221,30	96.333,18	133.554,48	44,64%	3.016.808,96	44,71%	3.054.030,26	44,71%	3.150.363,44	4.034.639,44	75,6952%	78,0829%
De 12 Meses a 2 Años	20	33.938,74	86.387,98	120.326,72	40,22%	1.839.026,60	27,26%	1.872.965,34	27,42%	1.959.353,32	2.925.781,83	64,0159%	66,9685%
Total cedente:	66	83.402,46	215.764,66	299.167,12	100%	6.747.033,30	100%	6.830.435,76	100%	7.046.200,42	9.497.474,63	71,9184%	74,1903%
Total listado:	66	83.402,46	215.764,66	299.167,12	100%	6.747.033,30	100%	6.830.435,76	100%	7.046.200,42	9.497.474,63	71,9184%	74,1903%

Impagados por antigüedad a 31/08/2009

Antigüedad de la deuda	Cuotas	Principal	% Principal	Intereses	% Intereses	Comisiones	Demora	Total deuda	% no cobrada
Caixa d'Estalvis de Catalunya									
Hasta 1 Mes	411	83.535,06	55,44%	144.233,92	49,43%	0,00	0,00	227.768,98	51,48%
De 1 a 2 Meses	190	37.928,80	25,17%	76.658,23	26,27%	0,00	0,00	114.587,03	25,90%
De 2 a 3 Meses	82	15.450,70	10,25%	34.234,48	11,73%	0,00	0,00	49.685,18	11,23%
De 3 a 6 Meses	70	13.122,39	8,71%	34.620,67	11,87%	0,00	0,00	47.743,06	10,79%
De 6 a 12 Meses	6	633,28	0,42%	2.027,34	0,69%	0,00	0,00	2.660,62	0,60%
Total cedente:	759	150.670,23	100,00%	291.774,64	100,00%	0,00	0,00	442.444,87	100,00%
Total listado:	759	150.670,23	100,00%	291.774,64	100,00%	0,00	0,00	442.444,87	100,00%

Antigüedad de la deuda	Cuotas	Principal	% Principal	Intereses	% Intereses	Comisiones	Demora	Total deuda	% no cobrada
Caixa d'Estalvis de Catalunya									
Hasta 1 Mes	12	2.376,64	2,85%	6.415,40	2,97%	0,00	0,00	8.792,04	2,94%
De 1 a 2 Meses	26	4.919,46	5,90%	12.392,60	5,74%	0,00	0,00	17.312,06	5,79%
De 2 a 3 Meses	30	5.223,07	6,26%	15.026,24	6,96%	0,00	0,00	20.249,31	6,77%
De 3 a 6 Meses	114	21.123,43	25,33%	57.460,35	26,63%	0,00	0,00	78.583,78	26,27%
De 6 a 12 Meses	178	33.498,89	40,17%	88.670,74	41,10%	0,00	0,00	122.169,63	40,84%
De 12 Meses a 2 Años	84	16.260,97	19,50%	35.799,33	16,59%	0,00	0,00	52.060,30	17,40%
Total cedente:	444	83.402,46	100,00%	215.764,66	100,00%	0,00	0,00	299.167,12	100,00%
Total listado:	444	83.402,46	100,00%	215.764,66	100,00%	0,00	0,00	299.167,12	100,00%

Tasa de Prepago a 31/08/2009

Incluir en WriteOff: No
 Cedente: 2013 Caixa d'Estalvis de Catalunya
 Tipo Listado: Por fecha valor

Fecha	Principal Pendiente (1)	% Sobre Inicial	Amortización de Principal Anticipada (Prepago) (2)	Datos del Mes		Datos de 3 Meses		Datos de 6 Meses		Datos de 12 Meses		Histórico	
				% Tasa Mensual	% Tasa Anual Equivalente	% Tasa Mensual Constante	% Tasa Anual Equivalente	% Tasa Mensual Constante	% Tasa Anual Equivalente	% Tasa Mensual Constante	% Tasa Anual Equivalente	% Tasa Mensual Constante	% Tasa Anual Equivalente
06/05/2005	1.500.007.678,35	100,000000%	0,00										
31/05/2005	1.472.743.453,86	98,182394%	14.716.454,22	0,98109193%	11,15814983%							1,16865702%	13,15669112%
30/06/2005	1.449.318.638,85	96,620748%	19.702.445,84	1,33780570%	14,92357302%							1,25453486%	14,05790841%
31/07/2005	1.423.908.712,35	94,926762%	22.240.093,63	1,53452064%	16,93692698%							1,34724511%	15,02119696%
31/08/2005	1.406.593.017,47	93,772388%	13.634.483,91	0,95753919%	10,90423366%	1,27406585%	14,26166980%					1,24252330%	13,93237490%
30/09/2005	1.389.871.519,51	92,657627%	13.757.258,36	0,97805536%	11,12545063%	1,15478202%	13,01027427%					1,18466285%	13,32531316%
31/10/2005	1.366.341.337,19	91,088956%	19.972.068,54	1,43697229%	15,94405577%	1,12130067%	12,65602762%					1,22337877%	13,73194663%
30/11/2005	1.340.520.568,83	89,367580%	22.410.123,15	1,64015554%	17,99997221%	1,34849092%	15,03407358%	1,30618454%	14,59579250%			1,27932211%	14,31643130%
31/12/2005	1.317.147.036,11	87,809353%	19.594.763,52	1,46172793%	16,19704962%	1,50905317%	16,67875516%	1,32669509%	14,80853366%			1,29811681%	14,51197834%
31/01/2006	1.298.368.615,78	86,557465%	15.724.169,88	1,19380521%	13,42149351%	1,42867494%	15,85910334%	1,26972769%	14,21644935%			1,28265038%	14,35108969%
28/02/2006	1.277.223.468,89	85,147795%	18.166.274,80	1,39916158%	15,55629221%	1,34805193%	15,02953640%	1,34324635%	14,97985369%			1,29025648%	14,43024632%
31/03/2006	1.251.468.608,64	83,430814%	22.307.018,83	1,74652435%	19,05778840%	1,44292182%	16,00492168%	1,47007076%	16,28215298%			1,32718804%	14,81364067%
30/04/2006	1.232.667.221,25	82,177394%	15.612.096,08	1,24750201%	13,98442809%	1,46113915%	16,19104064%	1,43910425%	15,96587120%			1,31670260%	14,70494950%
31/05/2006	1.209.616.726,92	80,640702%	19.850.818,23	1,61039556%	17,70175489%	1,53101627%	16,90144561%	1,43364478%	15,90999648%	1,35873432%	15,13988157%	1,33475489%	14,89199914%
30/06/2006	1.184.505.787,70	78,966648%	22.483.361,83	1,85871783%	20,15996288%	1,56787452%	17,27393686%	1,49942635%	16,58097358%	1,40112416%	15,57645950%	1,36707723%	15,22596939%
31/07/2006	1.162.177.789,02	77,478123%	19.147.589,01	1,61650447%	17,76305170%	1,69100104%	18,50719121%	1,56947265%	17,29005303%	1,40704163%	15,63724024%	1,37903486%	15,34921684%
31/08/2006	1.147.144.323,39	76,475897%	12.115.839,18	1,04251168%	11,81718363%	1,50359153%	16,62329306%	1,51114921%	16,70003112%	1,41527819%	15,72177443%	1,35467771%	15,09799380%
30/09/2006	1.133.398.712,78	75,559527%	10.676.710,89	0,93072081%	10,61430153%	1,19445336%	13,42830857%	1,37678330%	15,32602249%	1,41211121%	15,68927997%	1,32675352%	14,80913900%
31/10/2006	1.117.414.427,38	74,493914%	13.082.388,02	1,15426177%	13,00477983%	1,03973018%	11,78743529%	1,36187640%	15,17231310%	1,38933287%	15,45522687%	1,31361486%	14,67291797%
30/11/2006	1.099.522.480,82	73,301124%	15.154.204,30	1,35618477%	15,11355763%	1,14376169%	12,89382020%	1,31948182%	14,73377103%	1,36568852%	15,21164533%	1,31177968%	14,65387512%
31/12/2006	1.082.518.212,25	72,167511%	14.231.556,79	1,29433977%	14,47271353%	1,26492402%	14,16635088%	1,22455421%	13,74426487%	1,35239370%	15,07440114%	1,30699057%	14,60416205%
31/01/2007	1.067.137.349,76	71,142126%	12.803.049,08	1,18270981%	13,30475390%	1,27470439%	14,26832402%	1,15218670%	12,98286184%	1,35171986%	15,06743961%	1,29745440%	14,50509338%
28/02/2007	1.051.251.277,17	70,083060%	13.293.786,78	1,24574281%	13,96603862%	1,23786307%	13,88362525%	1,18589704%	13,33830293%	1,33894863%	14,93539883%	1,29132195%	14,44132933%
31/03/2007	1.032.546.196,63	68,836061%	16.325.737,95	1,55298151%	17,12361207%	1,32373836%	14,77789557%	1,28916215%	14,41886177%	1,32247718%	14,76482405%	1,29808261%	14,51162287%
30/04/2007	1.018.379.880,14	67,891644%	11.660.246,08	1,12927113%	12,74047807%	1,30641678%	14,59820410%	1,28558267%	14,38161394%	1,31327895%	14,66943268%	1,28758948%	14,40249853%
31/05/2007	1.003.049.084,95	66,869597%	12.888.579,29	1,26559642%	14,17336506%	1,31323094%	14,66893457%	1,27056320%	14,22516033%	1,28479350%	14,37339988%	1,28286844%	14,35335992%
30/06/2007	988.749.241,07	65,916279%	11.665.266,80	1,16298065%	13,09681821%	1,18302742%	13,30809760%	1,24906647%	14,00077875%	1,22651488%	13,76480857%	1,27470525%	14,26833305%
31/07/2007	975.604.811,61	65,039988%	10.679.983,96	1,08015091%	12,21883477%	1,16682602%	13,13738235%	1,23234654%	13,82588540%	1,18232122%	13,30066282%	1,26418009%	14,15858991%
31/08/2007	966.840.874,77	64,455728%	6.818.878,36	0,69893857%	8,07223781%	0,97873040%	11,13272074%	1,14254428%	12,88094688%	1,15506074%	13,01321771%	1,24181266%	13,92494261%
30/09/2007	957.677.475,60	63,844838%	6.474.026,20	0,66960618%	7,74585497%	0,81481015%	9,35122335%	0,99596981%	11,31820258%	1,13491532%	12,80023543%	1,22001169%	13,69665170%
31/10/2007	946.767.162,52	63,117488%	8.605.436,99	0,89857360%	10,26562019%	0,75386599%	8,68057220%	0,95765423%	10,90547556%	1,11438444%	12,58268635%	1,20654431%	13,55534956%
30/11/2007	938.428.497,24	62,561580%	6.220.323,10	0,65700664%	7,60533353%	0,73980263%	8,52516961%	0,85664644%	9,80898809%	1,05727401%	11,97491399%	1,18679544%	13,34775742%
31/12/2007	930.081.214,12	62,005097%	6.083.244,71	0,64823742%	7,50741555%	0,73312945%	8,45134498%	0,77126234%	8,87247013%	1,00454186%	11,41029850%	1,16798264%	13,14957997%

Fecha	Principal Pendiente (1)	% Sobre Inicial	Amortización de Principal Anticipada (Prepago) (2)	Datos del Mes		Datos de 3 Meses		Datos de 6 Meses		Datos de 12 Meses		Histórico	
				% Tasa Mensual	% Tasa Anual Equivalente	% Tasa Mensual Constante	% Tasa Anual Equivalente	% Tasa Mensual Constante	% Tasa Anual Equivalente	% Tasa Mensual Constante	% Tasa Anual Equivalente	% Tasa Mensual Constante	% Tasa Anual Equivalente
31/01/2008	923.588.381,73	61,572244%	4.258.934,59	0,45790997%	5,35862053%	0,58655858%	6,81601105%	0,66810288%	7,72909911%	0,94549209%	10,77409996%	1,14506838%	12,90763568%
29/02/2008	916.147.868,82	61,076212%	5.564.061,92	0,60243957%	6,99448445%	0,56821828%	6,60950883%	0,65190010%	7,54832490%	0,89268597%	10,20162565%	1,12728248%	12,71941448%
31/03/2008	907.581.292,78	60,505110%	6.102.255,43	0,66607757%	7,70652049%	0,57403659%	6,67506540%	0,65155585%	7,54448064%	0,81892209%	9,39630960%	1,11210203%	12,55847085%
30/04/2008	899.104.490,24	59,939993%	6.548.263,51	0,72150710%	8,32263793%	0,66175403%	7,65830380%	0,62179352%	7,21156389%	0,78511798%	9,02504622%	1,09908520%	12,42024932%
31/05/2008	889.858.369,74	59,323588%	6.817.852,21	0,75829364%	8,72944850%	0,71341923%	8,23297411%	0,63836110%	7,39702153%	0,74275007%	8,55775944%	1,08760834%	12,29821417%
30/06/2008	881.339.690,97	58,755679%	6.645.620,28	0,74681775%	8,60271823%	0,74045333%	8,53236529%	0,65459514%	7,57841592%	0,70809008%	8,17385014%	1,07640563%	12,17894378%
31/07/2008	872.040.845,30	58,135759%	6.678.745,41	0,75779469%	8,72394185%	0,75239792%	8,66436117%	0,70446049%	8,13356187%	0,68109773%	7,87384828%	1,06597733%	12,06778467%
31/08/2008	867.284.106,22	57,818644%	2.904.404,78	0,33305834%	3,92429446%	0,61164938%	7,09784229%	0,66020789%	7,64105537%	0,65118582%	7,54034827%	1,04666272%	11,86156220%
30/09/2008	861.821.072,36	57,454444%	3.486.934,44	0,40205216%	4,71935647%	0,49679033%	5,80126303%	0,61694652%	7,15724220%	0,62974247%	7,30058701%	1,02974739%	11,68059284%
31/10/2008	854.700.849,43	56,979765%	6.382.110,92	0,74053781%	8,53329949%	0,49066242%	5,73162463%	0,61967758%	7,18785349%	0,61629014%	7,14988373%	1,02067152%	11,58335395%
30/11/2008	847.545.480,21	56,502743%	5.069.249,70	0,59310222%	6,88958757%	0,57746906%	6,71372017%	0,59245178%	6,88227638%	0,61101768%	7,09075631%	1,00899234%	11,45807881%
31/12/2008	839.489.574,61	55,965685%	5.234.220,05	0,61757394%	7,16427554%	0,64957166%	7,52231992%	0,57078067%	6,63838525%	0,60855342%	7,06310935%	0,99829175%	11,34315751%
31/01/2009	834.321.088,44	55,621121%	5.636.115,39	0,67137408%	7,76555654%	0,62554878%	7,25363010%	0,55645469%	6,47683629%	0,62628499%	7,26187503%	0,98905585%	11,24385667%
28/02/2009	826.755.332,85	55,116740%	8.683.909,84	1,04083547%	11,79925758%	0,77504536%	8,91415141%	0,67410469%	7,79597896%	0,66203091%	7,66139227%	0,98720167%	11,22390901%
31/03/2009	813.799.313,09	54,253010%	11.741.914,37	1,42024054%	15,77266693%	1,04573016%	11,85159409%	0,84431199%	9,67424758%	0,72443721%	8,35510180%	0,99246712%	11,28054525%
30/04/2009	801.919.527,22	53,461028%	8.136.687,24	0,99983953%	11,35978873%	1,15442350%	13,00648794%	0,88723947%	10,14238870%	0,74752575%	8,61054143%	0,98981394%	11,25201120%
31/05/2009	792.369.848,10	52,824386%	6.678.605,40	0,83282738%	9,54862494%	1,08241421%	12,24293303%	0,92803103%	10,58517482%	0,75420918%	8,68436152%	0,98422676%	11,19189558%
30/06/2009	783.808.715,37	52,253647%	6.071.972,73	0,76630537%	8,81782792%	0,86297107%	9,87800624%	0,95459147%	10,87240824%	0,75591672%	8,70321297%	0,97765542%	11,12114312%
31/07/2009	776.532.361,12	51,768559%	3.856.201,34	0,49198245%	5,74662963%	0,69511348%	8,02973594%	0,92337103%	10,53469268%	0,73502737%	8,47234698%	0,96670643%	11,00314237%
31/08/2009	770.881.555,52	51,391841%	2.003.761,68	0,25803969%	3,05290630%	0,50449229%	5,88872225%	0,79140121%	9,09415900%	0,72984310%	8,41496836%	0,95233379%	10,84802586%

(1) Saldo de fin de mes

(2) Amortización de principal realizada durante el mes menos amortización de principal esperada al inicio del mes

Origen y aplicación de fondos

Fecha de pago: 15/09/2009 0:00:00

Caixa d'Estalvis de Catalunya**A. FONDOS DISPONIBLES**

Fondos Disponibles por Ingresos - Principal	22.804.928,54 €
Fondos Disponibles por Ingresos - Intereses	9.348.905,08 €
Fondos Disponibles por Ingresos - Demora	29.231,85 €
Fondos Disponibles por Rendimientos de Cuentas	70.771,72 €
Fondos Disponibles F.Reserva	20.246.986,31 €
Fondos Disponibles por Cobro Costas	27.144,37 €
Fondos Disponibles Otros	6,64 €
Total:	52.527.974,51

B. APLICACIÓN DE FONDOS

Impuestos	6,64 €
Gastos Terceros	10.453,69 €
Pago Costas	45.522,32 €
Comision Sociedad Gestora	81.222,01 €
Comision Agencia Pagos	13.144,51 €
Pago Cantidad Neta Swap	5.456.161,57 €
Pago Intereses Bonos Serie A2	2.535.051,45 €
Pago Intereses Bonos Serie B	96.214,26 €
Pago Intereses Bonos Serie C	139.833,24 €
Pago Intereses Bonos Serie D	145.155,30 €
Fondo Disponible para Amortización	23.372.760,70 €
Dotación Fondo Reserva	20.632.448,82 €
Total:	52.527.974,51

Source and Application of Funds

Payment date: 15/09/2009 0:00:00

Caixa d' Estalvis de Catalunya**A. AVAILABLE AMOUNTS**

Available Amounts of the revenues-principal	22.804.928,54 €
Available Amounts of the revenues-interest	9.348.905,08 €
Available Amounts of the revenues-default interest	29.231,85 €
Available Amounts of the income of accounts	70.771,72 €
Available Amounts of the Reserve Fund	20.246.986,31 €
Available Amounts for Costs Payment	27.144,37 €
Other Available Amounts	6,64 €

Total:	52.527.974,51
---------------	----------------------

B. APPLICATION OF FUNDS

Taxes	6,64 €
Expenses	10.453,69 €
Costs Payment	45.522,32 €
Management fee	81.222,01 €
Paying agent fee	13.144,51 €
Payment of Net Amount fo the Swap	5.456.161,57 €
Class A2 bonds interest	2.535.051,45 €
Class B bonds interest	96.214,26 €
Class C bonds interest	139.833,24 €
Class D bonds interest	145.155,30 €
Available Amounts for Amortisation	23.372.760,70 €
Allocation to the Initial Reserve Fund	20.632.448,82 €

Total:	52.527.974,51
---------------	----------------------