

Bonos Titulización de Activos Serie A1

Número de Bonos:		2.377											
Código ISIN:		ES0372222002											
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			
20/09/2012	0,9590%	57,34 €	45,30 €	136.297,18 €	0,00	2.974,01 €	20.423,50 €	20,42%	7.069.221,77 €	48.546.659,50 €	7.069.221,77 €	7.069.221,77 €	0,00 €
20/06/2012	1,1620%	80,39 €	63,51 €	191.087,03 €	0,00	3.674,77 €	23.397,51 €	23,40%	8.734.928,29 €	55.615.881,27 €	8.734.928,29 €	8.734.928,29 €	0,00 €
20/03/2012	1,7170%	129,43 €	102,25 €	307.655,11 €	0,00	2.748,60 €	27.072,28 €	27,07%	6.533.422,20 €	64.350.809,56 €	6.533.422,20 €	6.533.422,20 €	0,00 €
20/12/2011	1,8350%	153,21 €	124,10 €	364.180,17 €	0,00	3.208,74 €	29.820,88 €	29,82%	7.627.174,98 €	70.884.231,76 €	7.627.174,98 €	7.627.174,98 €	0,00 €
20/09/2011	1,7940%	171,04 €	138,54 €	406.562,08 €	0,00	4.277,27 €	33.029,62 €	33,03%	10.167.070,79 €	78.511.406,74 €	10.167.070,79 €	10.167.070,79 €	0,00 €
20/06/2011	1,4700%	153,08 €	123,99 €	363.871,16 €	0,00	3.891,08 €	37.306,89 €	37,31%	9.249.097,16 €	88.678.477,53 €	9.249.097,16 €	9.249.097,16 €	0,00 €
21/03/2011	1,3240%	157,51 €	127,58 €	374.401,27 €	0,00	5.865,35 €	41.197,97 €	41,20%	13.941.936,95 €	97.927.574,69 €	13.941.936,95 €	13.941.936,95 €	0,00 €
20/12/2010	1,1790%	156,23 €	126,55 €	371.358,71 €	0,00	5.359,34 €	47.063,32 €	47,06%	12.739.151,18 €	111.869.511,64 €	12.739.151,18 €	12.739.151,18 €	0,00 €
20/09/2010	1,0290%	151,61 €	122,80 €	360.376,97 €	0,00	5.863,31 €	52.422,66 €	52,42%	13.937.087,87 €	124.608.662,82 €	13.937.087,87 €	13.937.087,87 €	0,00 €
21/06/2010	0,9440%	155,55 €	126,00 €	369.742,35 €	0,00	6.902,27 €	58.285,97 €	58,29%	16.406.695,79 €	138.545.750,69 €	16.406.695,79 €	16.406.695,79 €	0,00 €
22/03/2010	1,0120%	187,15 €	151,59 €	444.855,55 €	0,00	7.972,23 €	65.188,24 €	65,19%	18.949.990,71 €	154.952.446,48 €	18.949.990,71 €	18.949.990,71 €	0,00 €
21/12/2009	1,0660%	211,81 €	173,68 €	503.472,37 €	0,00	5.443,62 €	73.160,47 €	73,16%	12.939.484,74 €	173.902.437,19 €	12.939.484,74 €	12.939.484,74 €	0,00 €
21/09/2009	1,5350%	328,13 €	269,07 €	779.965,01 €	0,00	5.962,81 €	78.604,09 €	78,60%	14.173.599,37 €	186.841.921,93 €	14.173.599,37 €	14.173.599,37 €	0,00 €
22/06/2009	1,9020%	457,97 €	375,54 €	1.088.594,69 €	0,00	7.648,27 €	84.566,90 €	84,57%	18.179.937,79 €	201.015.521,30 €	18.179.937,79 €	18.179.937,79 €	0,00 €
20/03/2009	3,4250%	809,12 €	663,48 €	1.923.278,24 €	0,00	4.428,30 €	92.215,17 €	92,22%	10.526.069,10 €	219.195.459,09 €	10.526.069,10 €	10.526.069,10 €	0,00 €
22/12/2008	5,5750%	1.068,54 €	876,20 €	2.539.919,58 €	0,00	3.356,53 €	96.643,47 €	96,64%	7.978.471,81 €	229.721.528,19 €	7.978.471,81 €	7.978.471,81 €	0,00 €
14/10/2008							100.000,00 €			237.700.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos Serie A2(G)

Número de Bonos: 1.898													
Código ISIN: ES0372222010													
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			
20/09/2012	1,2090%	72,29 €	57,11 €	137.206,42 €	0,00	2.974,01 €	20.423,50 €	20,42%	5.644.670,98 €	38.763.803,00 €	5.644.670,98 €	5.644.670,98 €	0,00 €
20/06/2012	1,4120%	97,69 €	77,18 €	185.415,62 €	0,00	3.674,77 €	23.397,51 €	23,40%	6.974.713,46 €	44.408.473,98 €	6.974.713,46 €	6.974.713,46 €	0,00 €
20/03/2012	1,9670%	148,27 €	117,13 €	281.416,46 €	0,00	2.748,60 €	27.072,28 €	27,07%	5.216.842,80 €	51.383.187,44 €	5.216.842,80 €	5.216.842,80 €	0,00 €
20/12/2011	2,0850%	174,08 €	141,00 €	330.403,84 €	0,00	3.208,74 €	29.820,88 €	29,82%	6.090.188,52 €	56.600.030,24 €	6.090.188,52 €	6.090.188,52 €	0,00 €
20/09/2011	2,0440%	194,87 €	157,84 €	369.863,26 €	0,00	4.277,27 €	33.029,62 €	33,03%	8.118.258,46 €	62.690.218,76 €	8.118.258,46 €	8.118.258,46 €	0,00 €
20/06/2011	1,7200%	179,12 €	145,09 €	339.969,76 €	0,00	3.891,08 €	37.306,89 €	37,31%	7.385.269,84 €	70.808.477,22 €	7.385.269,84 €	7.385.269,84 €	0,00 €
21/03/2011	1,5740%	187,25 €	151,67 €	355.400,50 €	0,00	5.865,35 €	41.197,97 €	41,20%	11.132.434,30 €	78.193.747,06 €	11.132.434,30 €	11.132.434,30 €	0,00 €
20/12/2010	1,4290%	189,36 €	153,38 €	359.405,28 €	0,00	5.359,34 €	47.063,32 €	47,06%	10.172.027,32 €	89.326.181,36 €	10.172.027,32 €	10.172.027,32 €	0,00 €
20/09/2010	1,2790%	188,44 €	152,64 €	357.659,12 €	0,00	5.863,31 €	52.422,66 €	52,42%	11.128.562,38 €	99.498.208,68 €	11.128.562,38 €	11.128.562,38 €	0,00 €
21/06/2010	1,1940%	196,75 €	159,37 €	373.431,50 €	0,00	6.902,27 €	58.285,97 €	58,29%	13.100.508,46 €	110.626.771,06 €	13.100.508,46 €	13.100.508,46 €	0,00 €
22/03/2010	1,2620%	233,39 €	189,05 €	442.974,22 €	0,00	7.972,23 €	65.188,24 €	65,19%	15.131.292,54 €	123.727.279,52 €	15.131.292,54 €	15.131.292,54 €	0,00 €
21/12/2009	1,3160%	261,48 €	214,41 €	496.289,04 €	0,00	5.443,62 €	73.160,47 €	73,16%	10.331.990,76 €	138.858.572,06 €	10.331.990,76 €	10.331.990,76 €	0,00 €
21/09/2009	1,7850%	381,57 €	312,89 €	724.219,86 €	0,00	5.962,81 €	78.604,09 €	78,60%	11.317.413,38 €	149.190.562,82 €	11.317.413,38 €	11.317.413,38 €	0,00 €
22/06/2009	2,1520%	518,17 €	424,90 €	983.486,66 €	0,00	7.648,27 €	84.566,90 €	84,57%	14.516.416,46 €	160.507.976,20 €	14.516.416,46 €	14.516.416,46 €	0,00 €
20/03/2009	3,6750%	868,18 €	711,91 €	1.647.805,64 €	0,00	4.428,30 €	92.215,17 €	92,22%	8.404.913,40 €	175.024.392,66 €	8.404.913,40 €	8.404.913,40 €	0,00 €
22/12/2008	5,8250%	1.116,46 €	915,50 €	2.119.041,08 €	0,00	3.356,53 €	96.643,47 €	96,64%	6.370.693,94 €	183.429.306,06 €	6.370.693,94 €	6.370.693,94 €	0,00 €
14/10/2008							100.000,00 €			189.800.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos Serie B

Número de Bonos: 175													
Código ISIN: ES0372222028													
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			
20/09/2012	1,2590%	321,74 €	254,17 €	56.304,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	17.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/06/2012	1,4620%	373,62 €	295,16 €	65.383,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	17.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/03/2012	2,0170%	509,85 €	402,78 €	89.223,75 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	17.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/12/2011	2,1350%	539,68 €	437,14 €	94.444,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	17.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/09/2011	2,0940%	535,13 €	433,46 €	93.647,75 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	17.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/06/2011	1,7700%	447,42 €	362,41 €	78.298,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	17.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
21/03/2011	1,6240%	410,51 €	332,51 €	71.839,25 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	17.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/12/2010	1,4790%	373,86 €	302,83 €	65.425,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	17.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/09/2010	1,3290%	335,94 €	272,11 €	58.789,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	17.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
21/06/2010	1,2440%	314,46 €	254,71 €	55.030,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	17.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
22/03/2010	1,3120%	331,64 €	268,63 €	58.037,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	17.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
21/12/2009	1,3660%	345,29 €	283,14 €	60.425,75 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	17.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
21/09/2009	1,8350%	463,85 €	380,36 €	81.173,75 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	17.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
22/06/2009	2,2020%	574,97 €	471,48 €	100.619,75 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	17.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/03/2009	3,7250%	910,56 €	746,66 €	159.348,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	17.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
22/12/2008	5,8750%	1.126,04 €	923,35 €	197.057,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	17.500.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
14/10/2008							100.000,00 €			17.500.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos Serie C

Número de Bonos:		200											
Código ISIN:		ES0372222036											
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			
20/09/2012	1,3590%	347,30 €	274,37 €	69.460,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	20.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/06/2012	1,5620%	399,18 €	315,35 €	79.836,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	20.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/03/2012	2,1170%	535,13 €	422,75 €	107.026,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	20.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/12/2011	2,2350%	564,96 €	457,62 €	112.992,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	20.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/09/2011	2,1940%	560,69 €	454,16 €	112.138,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	20.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/06/2011	1,8700%	472,69 €	382,88 €	94.538,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	20.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
21/03/2011	1,7240%	435,79 €	352,99 €	87.158,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	20.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/12/2010	1,5790%	399,14 €	323,30 €	79.828,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	20.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/09/2010	1,4290%	361,22 €	292,59 €	72.244,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	20.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
21/06/2010	1,3440%	339,73 €	275,18 €	67.946,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	20.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
22/03/2010	1,4120%	356,92 €	289,11 €	71.384,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	20.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
21/12/2009	1,4660%	370,57 €	303,87 €	74.114,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	20.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
21/09/2009	1,9350%	489,13 €	401,09 €	97.826,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	20.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
22/06/2009	2,3020%	601,08 €	492,89 €	120.216,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	20.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/03/2009	3,8250%	935,00 €	766,70 €	187.000,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	20.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
22/12/2008	5,9750%	1.145,21 €	939,07 €	229.042,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	20.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
14/10/2008							100.000,00 €			20.000.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos Serie D

Número de Bonos: 350													
Código ISIN: ES0372222044													
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			
20/09/2012	1,8590%	475,08 €	375,31 €	166.278,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/06/2012	2,0620%	526,96 €	416,30 €	184.436,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/03/2012	2,6170%	661,52 €	522,60 €	231.532,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/12/2011	2,7350%	691,35 €	559,99 €	241.972,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/09/2011	2,6940%	688,47 €	557,66 €	240.964,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/06/2011	2,3700%	599,08 €	485,25 €	209.678,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
21/03/2011	2,2240%	562,18 €	455,37 €	196.763,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/12/2010	2,0790%	525,53 €	425,68 €	183.935,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/09/2010	1,9290%	487,61 €	394,96 €	170.663,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
21/06/2010	1,8440%	466,12 €	377,56 €	163.142,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
22/03/2010	1,9120%	483,31 €	391,48 €	169.158,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
21/12/2009	1,9660%	496,96 €	407,51 €	173.936,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
21/09/2009	2,4350%	615,51 €	504,72 €	215.428,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
22/06/2009	2,8020%	731,63 €	599,94 €	256.070,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
20/03/2009	4,3250%	1.057,22 €	866,92 €	370.027,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
22/12/2008	6,4750%	1.241,04 €	1.017,65 €	434.364,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	35.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
14/10/2008							100.000,00 €			35.000.000,00 €			

Clasificación de la cartera por índices a 31/08/2012

Índice (1)			Número PH	%	Principal pendiente	%	Tipo nominal	Margen s/ Referencia	Principal/ Tasación	Vida residual	
										Meses	Fecha
Índice	CECA	Tipo Activo CECA	3	0,233281%	19.282,85	0,013337%	7,252685%	1,731404	0,000000	28,804540	25/01/2015
Índice	EICF	Euribor ICF Semestral (día 10)	1	0,077760%	63.954,83	0,044234%	1,470000%	0,000000	0,000000	49,314168	10/10/2016
Índice	ER1A	Euribor 1 año	779	60,575428%	115.798.698,23	80,092033%	2,623585%	0,915491	37,587023	117,022793	02/06/2022
Índice	EU44	Euribor 3 meses Central Anotac. Bco. España	155	12,052877%	12.555.151,37	8,683756%	1,570915%	0,994721	0,000000	39,656688	21/12/2015
Índice	EU47	Euribor 6 meses Central Anotac. Bco. España	10	0,777605%	643.454,36	0,445044%	1,802955%	0,983808	0,000000	36,511353	16/09/2015
Índice	EU53	Euribor 12 meses Central Anotac. Bco. España	21	1,632970%	3.460.968,10	2,393775%	2,424811%	0,804629	0,065089	74,345616	11/11/2018
Índice	EU55	Euribor ICO Semestral día 15 - MB4	2	0,155521%	170.462,76	0,117900%	1,711000%	0,000000	0,000000	26,480493	15/11/2014
Índice	EU57	Euribor ICO Semestral día 10 - MB5	17	1,321928%	633.882,49	0,438424%	1,450633%	0,000000	4,198186	16,443772	14/01/2014
Índice	EU73	Euribor ICO +0,75 Semestral día 20 - I07	2	0,155521%	1.297.630,06	0,897504%	1,474488%	0,000000	0,000000	52,585005	18/01/2017
Índice	F000	Tipo Fijo	139	10,808709%	2.215.447,67	1,532312%	5,744203%	0,000000	14,576647	62,466064	14/11/2017
Índice	I08	EURIBOR ICO IDAE 05 Semestral día 20	3	0,233281%	27.617,36	0,019102%	1,946583%	0,000000	0,000000	33,259370	09/06/2015
Índice	I11	EURIBOR ICO PIMES 07 Semestral día 15	78	6,065319%	4.130.833,74	2,857086%	1,539316%	0,000000	2,105157	29,639134	19/02/2015
Índice	I12	EURIBOR ICO INTERN. 05-06 Semestral día 20	1	0,077760%	77.915,18	0,053890%	1,360000%	0,000000	0,000000	14,652977	20/11/2013
Índice	I16	EURIBOR Semestral/ICO EMPREN. 08 T2 I16	1	0,077760%	39.101,13	0,027044%	1,518000%	0,000000	0,000000	31,605749	20/04/2015
Índice	MB08	Euribor ICO Semestral día 20 - MB8	1	0,077760%	222.324,52	0,153770%	1,667000%	0,000000	0,000000	57,626283	20/06/2017
Índice	MB1A	Mibor 1 Año	2	0,155521%	68.210,13	0,047177%	3,107629%	0,996101	31,228758	111,205294	07/12/2021
Índice	TAE1	Préstamos Hipotecarios Cajas TAE	68	5,287714%	3.155.739,01	2,182663%	4,018163%	0,326473	37,552355	146,507482	15/11/2024
Índice	TAE3	Tipo Activo C.E.C.A TAE	3	0,233281%	1.369,90	0,000947%	6,354313%	0,884304	0,000000	1,433776	14/10/2012
Total CatalunyaCaixa			1.286	100%	144.582.043,69	100%	2,552301%	0,851089	39,019832	104,878346	28/05/2021
Total cartera			1.286	100%	144.582.043,69	100%					
Media ponderada:							2,552301	0,851089	39,019832	104,878346	28/05/2021
Media simple:					112.427,72	3,165430	0,901026	19,434513	74,232400	07/11/2018	
Mínimo:					16,11	0,778000	-2,000000	0,000000	0,164271	05/09/2012	
Máximo:					2.716.074,27	10,650000	4,000000	72,691068	305,938398	28/02/2038	

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

Clasificación de la cartera por índices a 31/08/2012

Situación: Irregular
Incluir en WriteOff: No
Cedente: 2013 CatalunyaCaixa

Índice (1)		Número PH	%	Principal pendiente	%	Tipo nominal	Margen s/ Referencia	Principal/ Tasación	Vida residual		
									Meses	Fecha	
Índice	ER1A	Euribor 1 año	78	60,465116%	11.309.971,42	90,382620%	2,748908%	1,061682	39,183939	108,536059	17/09/2021
Índice	EU44	Euribor 3 meses Central Anotac. Bco. España	14	10,852713%	39.249,25	0,313657%	3,308887%	2,823754	0,000000	12,575332	18/09/2013
Índice	EU47	Euribor 6 meses Central Anotac. Bco. España	1	0,775194%	792,12	0,006330%	4,680000%	3,750000	0,000000	4,008214	31/12/2012
Índice	EU53	Euribor 12 meses Central Anotac. Bco. España	1	0,775194%	346.215,72	2,766752%	1,455000%	0,650000	0,000000	23,983573	31/08/2014
Índice	EU55	Euribor ICO Semestral día 15 - MB4	1	0,775194%	4.259,76	0,034041%	1,499000%	0,000000	0,000000	5,519507	15/02/2013
Índice	F000	Tipo Fijo	21	16,279070%	333.701,74	2,666747%	5,266000%	0,000000	0,000000	52,734558	22/01/2017
Índice	I11	EURIBOR ICO PIMES 07 Semestral día 15	9	6,976744%	443.321,41	3,542763%	1,728780%	0,000000	0,000000	30,160143	07/03/2015
Índice	TAE1	Préstamos Hipotecarios Cajas TAE	4	3,100775%	35.924,65	0,287089%	3,968216%	0,349211	20,738098	72,174436	06/09/2018
Total CatalunyaCaixa			129	100%	12.513.436,07	100%	2,749046%	0,987657	39,282168	101,484881	14/02/2021
Total cartera			129	100%	12.513.436,07	100%					
		<i>Media ponderada:</i>					2,749046	0,987657	39,282168	101,484881	14/02/2021
		<i>Media simple:</i>		97.003,38			3,506829	1,008140	21,256052	67,421422	14/04/2018
		<i>Mínimo:</i>		0,00			1,455000	0,000000	0,000000	0,000000	30/11/2011
		<i>Máximo:</i>		1.243.985,55			11,050000	5,500000	69,197020	270,948665	31/03/2035

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

Clasificación de los impagados desde primera cuota vencida a 31/08/2012

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
CatalunyaCaixa													
Hasta 1 Mes	66	68.608,75	11.440,98	80.049,73	29,39%	9.640.315,91	57,67%	9.708.924,66	57,29%	9.720.365,64	22.042.799,56	32,1811%	32,2222%
De 1 a 2 Meses	43	105.968,84	17.458,64	123.427,48	45,32%	5.215.683,92	31,20%	5.321.652,76	31,40%	5.339.111,40	14.339.765,08	35,2433%	35,3588%
De 2 a 3 Meses	21	56.391,09	12.482,24	68.873,33	25,29%	1.860.367,18	11,13%	1.916.758,27	11,31%	1.929.240,51	5.636.353,59	32,6295%	32,8391%
Total cedente:	130	230.968,68	41.381,86	272.350,54	100%	16.716.367,01	100%	16.947.335,69	100%	16.988.717,55	42.018.918,23	33,2863%	33,3754%
Total listado:	130	230.968,68	41.381,86	272.350,54	100%	16.716.367,01	100%	16.947.335,69	100%	16.988.717,55	42.018.918,23	33,2863%	33,3754%

Clasificación de los impagados desde primera cuota vencida a 31/08/2012

Situación: Irregular
 Incluir en WriteOff: No
 Cedente: 2013 CatalunyaCaixa

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
CatalunyaCaixa													
Hasta 1 Mes	4	4.835,81	0,00	4.835,81	0,19%	928.085,59	7,42%	932.921,40	6,23%	932.921,40	1.604.472,20	58,1451%	58,1451%
De 1 a 2 Meses	1	1.913,40	199,16	2.112,56	0,08%	85.024,72	0,68%	86.938,12	0,58%	87.137,28	240.200,00	36,1941%	36,2770%
De 2 a 3 Meses	1	4.166,30	0,00	4.166,30	0,16%	165.782,88	1,32%	169.949,18	1,13%	169.949,18	362.086,00	46,9361%	46,9361%
De 3 a 6 Meses	40	257.560,84	28.673,28	286.234,12	11,10%	3.084.466,05	24,65%	3.342.026,89	22,30%	3.370.700,17	7.355.804,96	35,1980%	35,4989%
De 6 a 12 Meses	46	496.424,21	27.786,76	524.210,97	20,32%	2.955.833,53	23,62%	3.452.257,74	23,04%	3.480.044,50	7.648.387,33	35,3282%	35,6120%
De 12 Meses a 2 Años	48	1.707.080,16	50.934,94	1.758.015,10	68,15%	5.294.243,30	42,31%	7.001.323,46	46,72%	7.052.258,40	20.408.910,78	33,0216%	33,2580%
Total cedente:	140	2.471.980,72	107.594,14	2.579.574,86	100%	12.513.436,07	100%	14.985.416,79	100%	15.093.010,93	37.619.861,27	35,1418%	35,3871%
Total listado:	140	2.471.980,72	107.594,14	2.579.574,86	100%	12.513.436,07	100%	14.985.416,79	100%	15.093.010,93	37.619.861,27	35,1418%	35,3871%

Clasificación de los impagados por antigüedad a 31/08/2012

Antigüedad de la deuda	Cuotas	Principal	% Principal	Intereses	% Intereses	Comisiones	Demora	Total deuda	% no cobrada
CatalunyaCaixa									
Hasta 1 Mes	143	162.540,06	70,37%	29.213,21	70,59%	0,00	0,00	191.753,27	70,41%
De 1 a 2 Meses	54	56.359,15	24,40%	10.099,30	24,41%	0,00	0,00	66.458,45	24,40%
De 2 a 3 Meses	18	12.069,47	5,23%	2.069,35	5,00%	0,00	0,00	14.138,82	5,19%
Total cedente:	215	230.968,68	100,00%	41.381,86	100,00%	0,00	0,00	272.350,54	100,00%
Total listado:	215	230.968,68	100,00%	41.381,86	100,00%	0,00	0,00	272.350,54	100,00%

Clasificación de los impagados por antigüedad a 31/08/2012

Antigüedad de la deuda	Cuotas	Principal	% Principal	Intereses	% Intereses	Comisiones	Demora	Total deuda	% no cobrada
CatalunyaCaixa									
Hasta 1 Mes	229	394.356,04	15,95%	2.097,35	1,95%	0,00	0,00	396.453,39	15,37%
De 1 a 2 Meses	115	194.285,25	7,86%	6.918,96	6,43%	0,00	0,00	201.204,21	7,80%
De 2 a 3 Meses	116	195.104,14	7,89%	8.681,49	8,07%	0,00	0,00	203.785,63	7,90%
De 3 a 6 Meses	331	545.918,73	22,08%	22.434,59	20,85%	0,00	0,00	568.353,32	22,03%
De 6 a 12 Meses	411	819.442,69	33,15%	36.772,21	34,18%	0,00	0,00	856.214,90	33,19%
De 12 Meses a 2 Años	122	322.873,87	13,06%	30.689,54	28,52%	0,00	0,00	353.563,41	13,71%
Total cedente:	1.324	2.471.980,72	100,00%	107.594,14	100,00%	0,00	0,00	2.579.574,86	100,00%
Total listado:	1.324	2.471.980,72	100,00%	107.594,14	100,00%	0,00	0,00	2.579.574,86	100,00%

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
08/10/2008	500.000.013,88	100,000000%	0,00										
31/10/2008	492.364.072,44	98,472812%	1.574.107,61	0,31482151%	3,71312548%							0,40645762%	4,76991816%
30/11/2008	485.821.510,25	97,164299%	1.532.655,12	0,31128492%	3,67212515%							0,35069308%	4,12808785%
31/12/2008	479.507.051,90	95,901408%	598.453,72	0,12318387%	1,46823239%							0,26775580%	3,16617185%
31/01/2009	473.349.577,36	94,669913%	325.584,31	0,06789980%	0,81176158%	0,16659694%	1,98094666%					0,21423380%	2,54072944%
28/02/2009	466.407.141,19	93,281426%	1.689.987,30	0,35702732%	4,20119182%	0,17967695%	2,13494314%					0,24074593%	2,85100381%
31/03/2009	457.583.438,43	91,516685%	2.883.143,31	0,61816020%	7,17084695%	0,34170455%	4,02426273%					0,30015577%	3,54299848%
30/04/2009	443.244.021,13	88,648802%	7.962.594,74	1,74014050%	18,99465693%	0,89067676%	10,17977739%	0,51405903%	5,99725316%			0,49615835%	5,79408326%
31/05/2009	434.081.445,04	86,816287%	3.923.891,20	0,88526658%	10,12092244%	1,06690288%	12,07765563%	0,60545711%	7,02836060%			0,53679919%	6,25477126%
30/06/2009	425.081.613,53	85,016320%	3.154.210,33	0,72664021%	8,37950292%	1,10789035%	12,51377029%	0,70537489%	8,14371317%			0,55059707%	6,41070822%
31/07/2009	414.338.901,69	82,867778%	4.727.167,66	1,11206119%	12,55803751%	0,89579358%	10,23540843%	0,87601009%	10,02014315%			0,59588446%	6,92085496%
31/08/2009	407.809.457,73	81,561889%	1.086.343,33	0,26218714%	3,10127012%	0,69343323%	8,01106042%	0,86680221%	9,91979047%			0,56201304%	6,53954624%
30/09/2009	399.135.051,04	79,827008%	1.944.038,79	0,47670272%	5,57280852%	0,61205695%	7,10241388%	0,84816839%	9,71639444%			0,54937844%	6,39694548%
31/10/2009	390.515.657,92	78,103129%	2.137.843,95	0,53561920%	6,24142450%	0,41752172%	4,89679285%	0,64865831%	7,51211734%	0,55782791%	6,49233272%	0,54208900%	6,31458226%
30/11/2009	384.242.862,56	76,848570%	1.201.888,16	0,30776952%	3,63135459%	0,43376109%	5,08273302%	0,55482882%	6,45848576%	0,55954276%	6,51168096%	0,52146703%	6,08121534%
31/12/2009	374.389.161,99	74,877830%	4.178.358,86	1,08742654%	12,29627984%	0,63184918%	7,32416769%	0,60809974%	7,05801861%	0,63362240%	7,34401127%	0,54700295%	6,37011211%
31/01/2010	361.129.794,45	72,225957%	7.664.625,58	2,04723490%	21,98099595%	1,12610773%	12,70696940%	0,74640706%	8,59817986%	0,78193285%	8,98999286%	0,61808222%	7,16997294%
28/02/2010	350.717.624,99	70,143523%	5.399.744,70	1,49523656%	16,53838410%	1,51876844%	16,77732861%	0,94256360%	10,74243983%	0,86674794%	9,91919860%	0,65232419%	7,55306060%
31/03/2010	338.600.877,91	67,720174%	6.806.528,42	1,94074319%	20,95704480%	1,80144096%	19,59901299%	1,17782277%	13,25328939%	0,96343778%	10,96788728%	0,70130127%	8,09848148%
30/04/2010	329.055.143,77	65,811027%	3.969.191,06	1,17223295%	13,19438977%	1,51590612%	16,74829789%	1,28784172%	14,40512321%	0,91295505%	10,42176089%	0,71187449%	8,21583970%
31/05/2010	321.372.426,90	64,274484%	3.201.718,88	0,97300375%	11,07102809%	1,34651031%	15,01360117%	1,40244713%	15,59005173%	0,91789852%	10,47537513%	0,71290537%	8,22727460%
30/06/2010	314.848.410,41	62,969680%	1.577.880,78	0,49098200%	5,73525757%	0,86879494%	9,94151708%	1,31664715%	14,70437441%	0,90416259%	10,32633000%	0,69611596%	8,04087654%
31/07/2010	304.661.971,77	60,932393%	4.881.958,13	1,55057417%	17,09928975%	0,98845544%	11,23739783%	1,22960016%	13,79712658%	0,93230229%	10,63142284%	0,71603252%	8,26195433%
31/08/2010	299.677.764,84	59,935551%	552.218,38	0,18125609%	2,15352008%	0,73265812%	8,44612865%	1,02327766%	11,61128617%	0,93592844%	10,67066858%	0,69033544%	7,97662026%
30/09/2010	293.631.994,26	58,726397%	1.288.235,80	0,42987367%	5,03825254%	0,71683513%	8,27085328%	0,77644248%	8,92954053%	0,94217781%	10,73826831%	0,67401806%	7,79501402%
31/10/2010	287.205.039,79	57,441006%	837.423,70	0,28519498%	3,36916492%	0,29385161%	3,46978365%	0,63498863%	7,35929765%	0,93330537%	10,64228069%	0,65479558%	7,58065364%
30/11/2010	281.097.692,42	56,219537%	2.001.922,65	0,69703604%	8,05110043%	0,46123751%	5,39657818%	0,58623682%	6,81239178%	0,96866188%	11,02422740%	0,64767678%	7,50115214%
31/12/2010	272.306.590,70	54,461317%	4.331.536,57	1,54093637%	17,00184953%	0,82076231%	9,41648043%	0,74934748%	8,63066829%	0,99942107%	11,35529256%	0,66176729%	7,65845173%
31/01/2011	265.900.299,31	53,180058%	2.131.914,18	0,78290950%	9,00074259%	0,99231488%	11,27890819%	0,61909983%	7,18137851%	0,89623086%	10,24016124%	0,65628314%	7,59725848%
28/02/2011	261.587.420,93	52,317483%	437.954,20	0,16470617%	1,95866742%	0,82517794%	9,46486376%	0,62300345%	7,22511941%	0,79460852%	9,12941936%	0,63718111%	7,38382405%
31/03/2011	253.833.567,78	50,766712%	3.552.063,33	1,35788767%	15,13114078%	0,75507913%	8,69396631%	0,76914412%	8,84912400%	0,73707155%	8,49496252%	0,64446646%	7,46527933%
30/04/2011	248.639.607,05	49,727920%	1.064.461,68	0,41935418%	4,91779116%	0,63768870%	7,38950139%	0,80041103%	9,19317901%	0,67973232%	7,85864885%	0,63193467%	7,32512447%
31/05/2011	244.393.797,49	48,878758%	494.678,48	0,19895401%	2,36149607%	0,65559462%	7,58957325%	0,72526784%	8,36430288%	0,62113451%	7,20417993%	0,61587087%	7,14518306%
30/06/2011	239.432.228,01	47,886444%	956.463,02	0,39136141%	4,59655607%	0,33144546%	3,90563557%	0,53579054%	6,24336271%	0,61684359%	7,15608826%	0,60420388%	7,01429268%
31/07/2011	232.238.530,28	46,447705%	3.215.265,05	1,34287062%	14,97596805%	0,62954672%	7,29839560%	0,61880067%	7,17802563%	0,58942883%	6,84829056%	0,60954231%	7,07420478%

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
31/08/2011	227.029.176,95	45,405834%	2.021.165,41	0,87029719%	9,95789282%	0,85189716%	9,75712917%	0,73354568%	8,45595126%	0,64331111%	7,45236607%	0,60630628%	7,03789169%
30/09/2011	223.432.513,34	44,686501%	189.140,06	0,08331090%	0,99516268%	0,76111667%	8,76059893%	0,52834581%	6,15911765%	0,62357274%	7,23149682%	0,59070721%	6,86266431%
31/10/2011	218.323.225,57	43,664644%	1.706.157,27	0,76361190%	8,78812433%	0,56532208%	6,57686080%	0,58377577%	6,78470498%	0,66511598%	7,69579876%	0,58611765%	6,81105126%
30/11/2011	213.358.665,16	42,671732%	2.058.042,56	0,94265855%	10,74346654%	0,58384734%	6,78551031%	0,70421414%	8,13082686%	0,68191710%	7,88296824%	0,58412812%	6,78866941%
31/12/2011	208.718.366,53	41,743672%	1.370.615,13	0,64239956%	7,44217663%	0,77199452%	8,88053866%	0,74898431%	8,62665620%	0,60739518%	7,05011227%	0,57789150%	6,71847649%
31/01/2012	205.467.298,46	41,093459%	110.035,71	0,05271971%	0,63080531%	0,54322918%	6,32746954%	0,54232134%	6,31720849%	0,55492574%	6,45957975%	0,56409211%	6,56299262%
29/02/2012	201.707.379,28	40,341475%	357.930,09	0,17420295%	2,07052242%	0,28807323%	3,40263038%	0,42978808%	5,03727297%	0,56165335%	6,53548926%	0,55248323%	6,43200621%
31/03/2012	198.187.142,06	39,637427%	511.891,60	0,25377931%	3,00320268%	0,15673349%	1,86467319%	0,46140603%	5,39850018%	0,47359559%	5,53742603%	0,54235072%	6,31754064%
30/04/2012	195.038.660,80	39,007731%	162.831,44	0,08216045%	0,98148231%	0,16781064%	1,99524539%	0,35205802%	4,14384507%	0,45193907%	5,29047483%	0,53065564%	6,18526330%
31/05/2012	192.010.110,91	38,402021%	392.080,79	0,20102722%	2,38583263%	0,17660734%	2,09882327%	0,22825478%	2,70493153%	0,45631353%	5,34040482%	0,52080317%	6,07369398%
30/06/2012	188.154.053,73	37,630810%	1.812.566,12	0,94399514%	10,75791762%	0,39978518%	4,69332870%	0,26909670%	3,18179395%	0,49743844%	5,80862541%	0,51934756%	6,05720036%
31/07/2012	183.373.135,90	36,674626%	2.072.711,43	1,10160339%	12,44700479%	0,73643752%	8,48794860%	0,43543916%	5,10192780%	0,47000965%	5,49657613%	0,51943574%	6,05819953%
31/08/2012	180.748.007,92	36,149601%	273.407,29	0,14909888%	1,77458711%	0,72723172%	8,38605358%	0,43650723%	5,11414326%	0,41368908%	4,85286061%	0,50983556%	5,94935368%

(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: 20/09/2012

A. FONDOS DISPONIBLES

Fondos disponibles principal	10.975.245,61 €
Fondos disponibles intereses	1.050.066,76 €
Fondos disponibles demora	28.233,75 €
Fondos disponibles Rendimientos de Cuentas	46.986,20 €
Fondos disponibles Fondo de Reserva	14.677.652,41 €
Fondos disponibles por Cobro Costas	5.608,72 €
Total:	26.783.793,45 €

B. APLICACIÓN DE FONDOS

Gastos periódicos y extraordinarios	644,65 €
Pago Costas	19.117,04 €
Comisión Agente de Pagos	6.250,00 €
Comisión Sociedad Gestora	11.022,39 €
Pago cantidad neta Swap	362.832,51 €
Intereses Bonos A1	136.297,18 €
Intereses Bonos A2 (G)	137.206,42 €
Intereses Bonos B	56.304,50 €
Intereses Bonos C	69.460,00 €
Intereses Bonos D	166.278,00 €
Cantidad Devengada Amortización Bonos	12.713.892,75 €
Dotación del Fondo de Reserva	13.104.488,01 €
Total:	26.783.793,45 €