

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Número de registro del Fondo: **9745**

NIF Fondo: **V-65385536**

Denominación del compartimento:

Número de registro del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

NIF gestora: **A-58481227**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:

Subsanación del envío del fichero anterior por respuesta al requerimiento de información adicional de la CNMV de fecha 3 de diciembre de 2012 (número de registro de salida 2012173024).

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.
Estados agregados: No
Periodo: 2º Semestre
Ejercicio: 2011

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2011		Periodo Anterior 31/12/2010
---------------------------------	--	-------------------------------------	--	---------------------------------------

ACTIVO				
---------------	--	--	--	--

A) ACTIVO NO CORRIENTE	0008	5.719.389	1008	6.156.749
-------------------------------	------	-----------	------	-----------

I. Activos financieros a largo plazo	0010	5.719.389	1010	6.156.749
1. Valores representativos de deuda	0100		1100	
1.1 Bancos centrales	0101		1101	
1.2 Administraciones Públicas españolas	0102		1102	
1.3 Entidades de crédito	0103		1103	
1.4 Otros sectores residentes	0104		1104	
1.5 Administraciones Públicas no residentes	0105		1105	
1.6 Otros sectores no residentes	0106		1106	
1.7 Activos dudosos	0107		1107	
1.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0108		1108	
1.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0109		1109	
1.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0110		1110	
2. Derechos de crédito	0200	5.650.011	1200	6.054.904
2.1 Participaciones hipotecarias	0201		1201	
2.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0202		1202	
2.3 Préstamos hipotecarios	0203	5.639.464	1203	6.054.904
2.4 Cédulas Hipotecarias	0204		1204	
2.5 Préstamos a promotores	0205		1205	
2.6 Préstamos a PYMES	0206		1206	
2.7 Préstamos a empresas	0207		1207	
2.8 Préstamos Corporativos	0208		1208	
2.9 Cédulas territoriales	0209		1209	
2.10 Bonos de Tesorería	0210		1210	
2.11 Deuda Subordinada	0211		1211	
2.12 Créditos AAPP	0212		1212	
2.13 Préstamos Consumo	0213		1213	
2.14 Préstamos automoción	0214		1214	
2.15 Cuotas de Arrendamiento financiero (leasing)	0215		1215	
2.16 Cuentas a cobrar	0216		1216	
2.17 Derechos de crédito futuros	0217		1217	
2.18 Bonos de titulación	0218		1218	
2.19 Otros	0219		1219	
2.20 Activos dudosos	0220	10.547	1220	
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221		1221	
2.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0222		1222	
2.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0223		1223	
3. Derivados	0230	69.378	1230	101.845
3.1 Derivados de cobertura	0231	69.378	1231	101.845
3.2 Derivados de negociación	0232		1232	
4. Otros activos financieros	0240		1240	
4.1 Garantías financieras	0241		1241	
4.2 Otros	0242		1242	

II. Activos por impuesto diferido	0250		1250	
--	------	--	------	--

III. Otros activos no corrientes	0260		1260	
---	------	--	------	--

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.				
Estados agregados: No				
Periodo: 2º Semestre				
Ejercicio: 2011				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2011		Periodo Anterior 31/12/2010
B) ACTIVO CORRIENTE	0270	423.434	1270	453.187
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0280		1280	
V. Activos financieros a corto plazo	0290	249.571	1290	265.032
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300		1300	
2. Valores representativos de deuda	0310		1310	
2.1 Bancos centrales	0311		1311	
2.2 Administraciones Públicas españolas	0312		1312	
2.3 Entidades de crédito	0313		1313	
2.4 Otros sectores residentes	0314		1314	
2.5 Administraciones Públicas no residentes	0315		1315	
2.6 Otros sectores no residentes	0316		1316	
2.7 Activos dudosos	0317		1317	
2.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0318		1318	
2.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0319		1319	
2.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0320		1320	
2.11 Intereses vencidos e impagados	0330		1330	
3. Derechos de crédito	0400	249.571	1400	265.032
3.1 Participaciones hipotecarias	0401		1401	
3.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0402		1402	
3.3 Préstamos hipotecarios	0403	235.862	1403	251.936
3.4 Cédulas Hipotecarias	0404		1404	
3.5 Préstamos a promotores	0405		1405	
3.6 Préstamos a PYMES	0406		1406	
3.7 Préstamos a empresas	0407		1407	
3.8 Préstamos Corporativos	0408		1408	
3.9 Cédulas territoriales	0409		1409	
3.10 Bonos de Tesorería	0410		1410	
3.11 Deuda Subordinada	0411		1411	
3.12 Créditos AAPP	0412		1412	
3.13 Préstamos Consumo	0413		1413	
3.14 Préstamos automoción	0414		1414	
3.15 Arrendamiento financiero	0415		1415	
3.16 Cuentas a cobrar	0416		1416	
3.17 Derechos de crédito futuros	0417		1417	
3.18 Bonos de titulización	0418		1418	
3.19 Otros	0419		1419	
3.20 Activos dudosos	0420	604	1420	1.350
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421	-723	1421	-48
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	13.779	1422	11.794
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423		1423	
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	49	1424	
4. Derivados	0430		1430	
4.1 Derivados de cobertura	0431		1431	
4.2 Derivados de negociación	0432		1432	
5. Otros activos financieros	0440		1440	
5.1 Garantías financieras	0441		1441	
5.2 Otros	0442		1442	
VI. Ajustes por periodificaciones	0450		1450	
1. Comisiones	0451		1451	
2. Otros	0452		1452	
VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes	0460	173.863	1460	188.155
1. Tesorería	0461	173.863	1461	188.155
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462		1462	

TOTAL ACTIVO	0500	6.142.823	1500	6.609.936
--------------	------	-----------	------	-----------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.				
Estados agregados: No				
Periodo: 2º Semestre				
Ejercicio: 2011				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2011		Periodo Anterior 31/12/2010
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0650	5.823.956	1650	6.243.928
I. Provisiones a largo plazo	0660		1660	
II. Pasivos financieros a largo plazo	0700	5.823.956	1700	6.243.928
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	5.693.548	1710	6.113.286
1.1 Series no subordinadas	0711	5.401.048	1711	5.723.286
1.2 Series subordinadas	0712	292.500	1712	390.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0713		1713	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0714		1714	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0715		1715	
2. Deudas con entidades de crédito	0720	130.408	1720	130.642
2.1 Préstamo subordinado	0721	130.408	1721	130.642
2.2 Crédito línea de liquidez	0722		1722	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723		1723	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724		1724	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0725		1725	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0726		1726	
3. Derivados	0730		1730	
3.1 Derivados de cobertura	0731		1731	
3.2 Derivados de negociación	0732		1732	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0733		1733	
4. Otros pasivos financieros	0740		1740	
4.1 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0741		1741	
4.2 Otros	0742		1742	
III. Pasivos por impuesto diferido	0750		1750	
B) PASIVO CORRIENTE	0760	249.489	1760	264.163
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0770		1770	
V. Provisiones a corto plazo	0780		1780	
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0800	248.471	1800	262.661
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	4	1810	4
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	241.808	1820	257.220
2.1 Series no subordinadas	0821	235.806	1821	251.912
2.2 Series subordinadas	0822		1822	
2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0823		1823	
2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0824	6.002	1824	5.308
2.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0825		1825	
2.6 Intereses vencidos e impagados	0826		1826	
3. Deudas con entidades de crédito	0830	198	1830	175
3.1 Préstamo subordinado	0831		1831	
3.2 Crédito línea de liquidez	0832		1832	
3.3 Otras deudas con entidades de crédito	0833		1833	
3.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0834		1834	
3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0835	198	1835	175
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836		1836	
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837		1837	
4. Derivados	0840	6.461	1840	5.262
4.1 Derivados de cobertura	0841	6.461	1841	5.262
4.2 Derivados de negociación	0842		1842	
4.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0843		1843	
5. Otros pasivos financieros	0850		1850	
5.1 Importe bruto	0851		1851	
5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0852		1852	

VII. Ajustes por periodificación	0900	1.018	1900	1.502
1. Comisiones	0910	1.018	1910	1.502
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	26	1911	28
1.2 Comisión administrador	0912	262	1912	28
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0913		1913	
1.4 Comisión variable - resultados realizados	0914	730	1914	1.446
1.5 Comisión variable - resultados no realizados	0915		1915	
1.6 Otras comisiones del cedente	0916		1916	
1.7 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0917		1917	
1.8 Otras comisiones	0918		1918	
2. Otros	0920		1920	
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0930	69.378	1930	101.845
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0940		1940	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0950	69.378	1950	101.845
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0960		1960	
XI. Gastos de constitución en transición	0970		1970	
TOTAL PASIVO	1000	6.142.823	2000	6.609.936

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.02

Denominación del Fondo: FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS								
Denominación del compartimento:								
Denominación de la gestora: GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.								
Estados agregados: No								
Periodo: 2º Semestre								
Ejercicio: 2011								

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual 2º semestre		P. Corriente Anterior 2º semestre		Acumulado Actual 31/12/2011		Acumulado Anterior 31/12/2010
1. Intereses y rendimientos asimilados	0100	82.096	1100	79.900	2100	155.944	3100	65.550
1.1 Valores representativos de deuda	0110		1110		2110		3110	
1.2 Derechos de crédito	0120	80.384	1120	64.551	2120	152.961	3120	64.551
1.3 Otros activos financieros	0130	1.712	1130	15.349	2130	2.983	3130	999
2. Intereses y cargas asimiladas	0200	-75.344	1200	-54.622	2200	-140.167	3200	-54.622
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210	-73.014	1210	-52.899	2210	-135.779	3210	-52.899
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220	-2.330	1220	-1.723	2220	-4.388	3220	-1.723
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230		3230	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0240	9.100	1240		2240	14.949	3240	14.350
A) MARGEN DE INTERESES	0250	15.852	1250	25.278	2250	30.726	3250	25.278
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0300		1300		2300		3300	
4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0310		1310		2310		3310	
4.2 Activos financieros disponibles para la venta	0320		1320		2320		3320	
4.3 Otros	0330		1330		2330		3330	
5. Diferencias de cambio (neto)	0400		1400		2400		3400	
6. Otros ingresos de explotación	0500		1500		2500		3500	
7. Otros gastos de explotación	0600	-13.569	1600	-25.230	2600	-28.060	3600	-25.230
7.1 Servicios exteriores	0610	-40	1610	-637	2610	-42	3610	-637
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611	-40	1611	-637	2611	-42	3611	-637
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0612		1612		2612		3612	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0613		1613		2613		3613	
7.1.4 Otros servicios	0614		1614		2614		3614	
7.2 Tributos	0620		1620		2620		3620	
7.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630	-13.529	1630	-24.593	2630	-28.018	3630	-24.593
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631	-309	1631	-285	2631	-626	3631	-285
7.3.2 Comisión administrador	0632	-3.052	1632	-279	2632	-5.003	3632	-279
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633	-10	1633	-5	2633	-20	3633	-5
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados (neto)	0634	-10.158	1634	-24.024	2634	-22.369	3634	-24.024
7.3.5 Comisión variables - resultados no realizados (neto)	0635		1635		2635		3635	
7.3.6 Otras comisiones del cedente	0636		1636		2636		3636	
7.3.7 Otros gastos	0637		1637		2637		3637	
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0700	-2.283	1700	-48	2700	-2.666	3700	-48
8.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda	0710		1710		2710		3710	
8.2 Deterioro neto de derechos de crédito	0720	-2.283	1720	-48	2720	-2.666	3720	-48
8.3 Deterioro neto de derivados	0730		1730		2730		3730	
8.4 Deterioro neto de otros activos financieros	0740		1740		2740		3740	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0750		1750		2750		3750	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0800		1800		2800		3800	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0850		1850		2850		3850	
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0900	0	1900	0	2900	0	3900	0
12. Impuesto sobre beneficios	0950		1950		2950		3950	
C) RESULTADO DEL PERIODO	3000	0	4000	0	5000	0	6000	0

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.03

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2011		Mismo Periodo año Anterior 31/12/2010
A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN	8000	2.559	9000	495
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	8100	30.535	9100	24.218
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	150.856	9110	52.744
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-135.087	9120	-47.590
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	16.148	9130	19.612
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	3.006	9140	999
1.5 Intereses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito	8150	-4.388	9150	-1.547
1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	8160		9160	
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo	8200	-28.502	9200	-23.089
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-628	9210	-256
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220	-4.769	9220	-251
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-20	9230	-5
2.4 Comisiones variables pagadas	8240	-23.085	9240	-22.577
2.5 Otras comisiones	8250		9250	
3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo	8300	526	9300	-634
3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos	8310	568	9310	
3.2 Pagos de provisiones	8320		9320	
3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta	8325		9325	
3.4 Otros	8330	-42	9330	-634
B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION	8350	-16.851	9350	187.660
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	8400		9400	6.500.000
4.1 Cobros por emisión de valores de titulización	8410		9410	6.500.000
4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)	8420		9420	
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	8500		9500	-6.500.000
5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito	8510		9510	-6.500.000
5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras	8520		9520	
6. Flujos de caja netos por amortizaciones	8600	-16.618	9600	57.018
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	419.225	9610	191.820
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620		9620	
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-435.843	9630	-134.802
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	8700	-233	9700	130.642
7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos	8710		9710	130.700
7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos	8720	-233	9720	-58
7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso	8730		9730	
7.4 Administraciones públicas - Pasivo	8740		9740	
7.5 Otros deudores y acreedores	8750		9750	
7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras	8770		9770	
7.7 Cobros de Subvenciones	8780		9780	
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	8800	-14.292	9800	188.155
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	188.155	9900	0
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	173.863	9990	188.155

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

Denominación del Fondo: FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.
Estados agregados: No
Periodo: 2º Semestre
Ejercicio: 2011

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS <i>(miles de euros)</i>		Periodo Actual 31/12/2011		Mismo Periodo año Anterior 31/12/2010
1 Activos financieros disponibles para la venta				
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6010		7010	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6020		7020	
1.1.2 Efecto fiscal	6021		7021	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6022		7022	
1.3 Otras reclasificaciones	6030		7030	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6040		7040	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	6100		7100	
2 Cobertura de los flujos de efectivo				
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6110	-17.518	7110	116.195
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	-17.518	7120	116.195
2.1.2 Efecto fiscal	6121		7121	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	-14.949	7122	-14.350
2.3 Otras reclasificaciones	6130		7130	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	32.467	7140	-101.845
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	6200	0	7200	0
3 Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos				
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	6310		7310	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6320		7320	
3.1.2 Efecto fiscal	6321		7321	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6322		7322	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6330		7330	
Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	6400	0	7400	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	6500	0	7500	0

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

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

Tipología de activos titulizados	Situación actual 31/12/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 22/07/2010			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)		
Participaciones hipotecarias	0001		0030		0060		0090		0120		0150	
Certificados de transmisión hipotecaria	0002		0031		0061		0091		0121		0151	
Préstamos hipotecarios	0003	55.544	0032	5.886.398	0062	56.595	0092	6.308.182	0122	57.038	0152	6.500.000
Cédulas hipotecarias	0004		0033		0063		0093		0123		0153	
Préstamos a promotores	0005		0034		0064		0094		0124		0154	
Préstamos a PYMES	0007		0036		0066		0096		0126		0156	
Préstamos a empresas	0008		0037		0067		0097		0127		0157	
Préstamos Corporativos	0009		0038		0068		0098		0128		0158	
Cédulas territoriales	0010		0039		0069		0099		0129		0159	
Bonos de tesorería	0011		0040		0070		0100		0130		0160	
Deuda subordinada	0012		0041		0071		0101		0131		0161	
Créditos AAPP	0013		0042		0072		0102		0132		0162	
Préstamos consumo	0014		0043		0073		0103		0133		0163	
Préstamos automoción	0015		0044		0074		0104		0134		0164	
Arrendamiento financiero	0016		0045		0075		0105		0135		0165	
Cuentas a cobrar	0017		0046		0076		0106		0136		0166	
Derechos de crédito futuros	0018		0047		0077		0107		0137		0167	
Bonos de titulización	0019		0048		0078		0108		0138		0168	
Otros	0020		0049		0079		0109		0139		0169	
Total	0021	55.544	0050	5.886.398	0080	56.595	0110	6.308.182	0140	57.038	0170	6.500.000

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

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

CUADRO B

Movimiento de la cartera de activos titulizados/Tasa de amortización anticipada	Situación actual 31/12/2011		Situación cierre anual anterior 31/12/2010	
	Código	Importe	Código	Importe
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196	-1.642	0206	
Derechos de crédito dados de baja por dación/adjudicación de bienes desde el cierre anual anterior	0197	-92	0207	
Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior	0200	-300.985	0210	-108.783
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-119.065	0211	-83.072
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-611.997	0212	-191.855
Importe de principal pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1)	0203	0	0213	6.500.037
Principal pendiente cierre del periodo (2)	0204	5.886.398	0214	6.308.182
Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)	0205	1,99	0215	1,30

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

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

CUADRO C

Total Impagados (1)	Nº de activos	Importe impagado							Deuda Total			
		Principal pendiente vencido		Intereses ordinarios (2)		Total		Principal pendiente no vencido				
Hasta 1 mes	0700	75	0710	22	0720	19	0730	41	0740	9.270	0750	9.311
De 1 a 3 meses	0701	45	0711	34	0721	30	0731	64	0741	6.053	0751	6.117
De 3 a 6 meses	0703	38	0713	83	0723	70	0733	153	0743	6.585	0753	6.738
De 6 a 9 meses	0704	24	0714	48	0724	46	0734	94	0744	3.071	0754	3.165
De 9 a 12 meses	0705	11	0715	37	0725	29	0735	66	0745	1.248	0755	1.314
De 12 meses a 2 años	0706	0	0716	0	0726	0	0736	0	0746	0	0756	0
Más de 2 años	0708	0	0718	0	0728	0	0738	0	0748	0	0758	0
Total	0709	193	0719	224	0729	194	0739	418	0749	26.227	0759	26.645

(1) La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluido el de inicio e incluido el final (p.e. De 1 a 3 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 3 meses)

(2) Importe de intereses cuyo devengo, en su caso, se ha interrumpido conforme lo establecido en el apartado 12 de la norma 13ª de la Circular(p.e. De 1 a 3 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 3 meses)

Impagados con garantía real (2)	Nº de activos	Importe impagado							Deuda Total	Valor garantía (3)	Valor Garantía con Tasación > 2 años (4)	% Deuda/v. Tasación				
		Principal pendiente vencido		Intereses ordinarios		Total		Principal pendiente no vencido								
Hasta 1 mes	0772	75	0782	22	0792	19	0802	41	0812	9.270	0822	9.311	0832	22.951	0842	40,67
De 1 a 3 meses	0773	45	0783	34	0793	30	0803	64	0813	6.053	0823	6.117	0833	14.356	0843	42,71
De 3 a 6 meses	0774	38	0784	83	0794	70	0804	153	0814	6.585	0824	6.738	0834	15.760	0844	42,86
De 6 a 9 meses	0775	24	0785	48	0795	46	0805	94	0815	3.071	0825	3.165	0835	7.745	0845	40,95
De 9 a 12 meses	0776	11	0786	37	0796	29	0806	66	0816	1.248	0826	1.314	0836	2.730	0846	48,28
De 12 meses a 2 años	0777	0	0787	0	0797	0	0807	0	0817	0	0827	0	0837	0	0847	0,00
Más de 2 años	0778	0	0788	0	0798	0	0808	0	0818	0	0828	0	0838	0	0848	0,00
Total	0779	193	0789	224	0799	194	0809	418	0819	26.227	0829	26.645	0839	63.542	0849	42,03

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

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

(4) Se incluirá el valor de las garantías que tengan una tasación superior a dos años

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2011

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

CUADRO D	Situación actual 31/12/2011						Situación cierre anual anterior 31/12/2010						Escenario inicial					
	Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)		Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)		Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)	
Participaciones hipotecarias	0850	0868	0886	0886	0886	0886	0904	0922	0940	0940	0940	0958	0976	0994	0994	0994	0994	0994
Certificados de transmisión de hipoteca	0851	0869	0887	0887	0887	0887	0905	0923	0941	0941	0941	0959	0977	0995	0995	0995	0995	0995
Préstamos hipotecarios	0852	0,19 0870	0,03 0888	0,00 0888	0,00 0888	0,00 0888	0906	0,02 0924	0,00 0942	0,00 0942	0,00 0942	0960	3,40 0978	0,56 0996	50,00 0996	50,00 0996	50,00 0996	50,00 0996
Cédulas Hipotecarias	0853	0871	0889	0889	0889	0889	0907	0925	0943	0943	0943	0961	0979	0997	0997	0997	0997	0997
Préstamos a promotores	0854	0872	0890	0890	0890	0890	0908	0926	0944	0944	0944	0962	0980	0998	0998	0998	0998	0998
Préstamos a PYMES	0855	0873	0891	0891	0891	0891	0909	0927	0945	0945	0945	0963	0981	0999	0999	0999	0999	0999
Préstamos a empresas	0856	0874	0892	0892	0892	0892	0910	0928	0946	0946	0946	0964	0982	1000	1000	1000	1000	1000
Préstamos Corporativos	0857	0875	0893	0893	0893	0893	0911	0929	0947	0947	0947	0965	0983	1001	1001	1001	1001	1001
Cédulas Territoriales	1066	1084	1102	1102	1102	1102	1120	1138	1156	1156	1156	1174	1192	1210	1210	1210	1210	1210
Bonos de Tesorería	0858	0876	0894	0894	0894	0894	0912	0930	0948	0948	0948	0966	0984	1002	1002	1002	1002	1002
Deuda subordinada	0859	0877	0895	0895	0895	0895	0913	0931	0949	0949	0949	0967	0985	1003	1003	1003	1003	1003
Créditos AAPP	0860	0878	0896	0896	0896	0896	0914	0932	0950	0950	0950	0968	0986	1004	1004	1004	1004	1004
Préstamos Consumo	0861	0879	0897	0897	0897	0897	0915	0933	0951	0951	0951	0969	0987	1005	1005	1005	1005	1005
Préstamos automoción	0862	0880	0898	0898	0898	0898	0916	0934	0952	0952	0952	0970	0988	1006	1006	1006	1006	1006
Cuotas arrendamiento financiero	0863	0881	0899	0899	0899	0899	0917	0935	0953	0953	0953	0971	0989	1007	1007	1007	1007	1007
Cuentas a cobrar	0864	0882	0900	0900	0900	0900	0918	0936	0954	0954	0954	0972	0990	1008	1008	1008	1008	1008
Derechos de crédito futuros	0865	0883	0901	0901	0901	0901	0919	0937	0955	0955	0955	0973	0991	1009	1009	1009	1009	1009
Bonos de titulización	0866	0884	0902	0902	0902	0902	0920	0938	0956	0956	0956	0974	0992	1010	1010	1010	1010	1010
Otros	0867	0885	0903	0903	0903	0903	0921	0939	0957	0957	0957	0975	0993	1011	1011	1011	1011	1011

(1) Estos ratios se referirán exclusivamente a la cartera de activos cedidos al Fondo (presentados en el balance en la partida de "derechos de crédito") y se expresaran en términos porcentuales

(A) Determinada por el cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos a la fecha de presentación de la información, y el principal pendiente (sin incluir intereses, e incluyendo principales impagados) del total activos dados de alta en el balance a la fecha de presentación de la información. La clasificación como dudosos se realizará con arreglo a lo previsto en las Normas 13ª y 23ª

(B) Determinada por el cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos a la fecha de presentación de la información, y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en el balance a la fecha de presentación de la información más el principal de los activos clasificados como fallidos. Se considerará la definición de fallidos recogida en la Circular (no necesariamente coincidentes con la definición de la escritura o folleto, recogidas en el estado 5.4)

(D) Determinada por el cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de principal de activos clasificados como fallidos al cierre del mismo periodo del año anterior

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

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

CUADRO E Vida residual de los activos cedidos al Fondo (1)	Situación actual 31/12/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 22/07/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior a 1 año	1300	32	1310	1.040	1320	24	1330	1.815	1340		1350	
Entre 1 y 2 años	1301	28	1311	767	1321	12	1331	979	1341		1351	
Entre 2 y 3 años	1302	111	1312	4.982	1322	12	1332	1.103	1342		1352	
Entre 3 y 5 años	1303	499	1313	28.704	1323	268	1333	20.721	1343	168	1353	14.338
Entre 5 y 10 años	1304	3.380	1314	247.070	1324	2.710	1334	224.628	1344	2.372	1354	209.039
Superior a 10 años	1305	51.494	1315	5.603.835	1325	53.569	1335	6.058.936	1345	54.498	1355	6.276.623
Total	1306	55.544	1316	5.886.398	1326	56.595	1336	6.308.182	1346	57.038	1356	6.500.000
Vida residual media ponderada (años)	1307	21,56			1327	22,42			1347	22,86		

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

Antigüedad	Situación actual 31/12/2011		Situación cierre anual anterior 31/12/2010		Situación inicial 22/07/2010	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	6,29	0632		0634	5,70

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

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

CUADRO A		Situación actual 31/12/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Escenario inicial 22/07/2010			
		Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)		
Serie (2)		0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0337790002	A	61.100	90.660	5.539.355	8,87	61.100	97.794	5.975.213	8,37	61.100	100.000	6.110.000	9,98
ES0337790010	B	975	100.000	97.500	13,62	975	100.000	97.500	13,28	975	100.000	97.500	15,57
ES0337790028	C	2.925	100.000	292.500	13,62	2.925	100.000	292.500	13,28	2.925	100.000	292.500	15,57
Total		8006	65.000	8025	5.929.355	8045	65.000	8065	6.365.213	8085	65.000	8105	6.500.000

(1) Importes en años. En caso de ser estimado se indicará en las notas explicativas las hipótesis de estimación

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

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

Serie (1)	Denominación serie	Grado de subordinación (2)	Índice de referencia (3)	Margen (4)	Tipo aplicado	Intereses				Principal pendiente		Corrección de valor por repercusión de pérdidas							
						Base de cálculo de intereses	Días Acumulados (5)	Intereses Acumulados (6)	Intereses impagados	Principal no vencido	Principal impagado	Total pendiente	valor por pérdidas						
														9990	9991	9993	9997	9994	9995
ES0337790002	A	NS	EURIBOR A TRES MESES	0,80	2,22	360	16	5.473		5.539.355		5.539.355							
ES0337790010	B	S	EURIBOR A TRES MESES	1,25	2,67	360	16	116		97.500		97.500							
ES0337790028	C	S	EURIBOR A TRES MESES	1,75	3,17	360	16	412		292.500		292.500							
Total								9228	6.001	9105		9085	5.929.355	9095		9115	5.929.355	9227	

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

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

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

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

(5) Días acumulados desde la última fecha de pago

(6) Intereses acumulados desde la última fecha de pago

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

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

CUADRO C			Situación actual 31/12/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010											
			Amortización principal		Intereses		Amortización principal		Intereses									
Serie (1)	Denominación serie	Fecha final (2)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)								
		7290	7300	7310	7320	7330	7340	7350	7360	7370								
ES0337790002	A	01-03-2050	435.843	570.645	123.511	167.054	134.802	134.802	43.542	43.542								
ES0337790010	B	01-03-2050	0	0	2.523	3.391	0	0	868	868								
ES0337790028	C	01-03-2050	0	0	9.052	12.233	0	0	3.181	3.181								
Total			7305	435.843	7315	570.645	7325	135.086	7335	182.678	7345	134.802	7355	134.802	7365	47.591	7375	47.591

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

(2) Entendiendo como fecha final aquella que de acuerdo con la documentación contractual determine la extinción del Fondo, siempre que no se haya producido previamente una causa de liquidación anticipada

(3) Total de pagos realizados desde el último cierre anual

(4) Total de pagos realizados desde la fecha de constitución del Fondo

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

CUADRO D

Serie (1)	Denominación serie	Calificación				
		Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Situación actual	Situación anual cierre anterior	Situación inicial
		3310	3330	3350	3360	3370
ES0337790002	A	22-07-2010	MDY	Aa2(sf)	Aaa(sf)	Aaa
ES0337790002	A	22-07-2010	SYP	AA+(sf)	AAA(sf)	AAA
ES0337790010	B	22-07-2010	MDY	A1(sf)	A1(sf)	A1
ES0337790010	B	22-07-2010	SYP	AA(sf)	AA(sf)	AA
ES0337790028	C	22-07-2010	MDY	B1(sf)	B1(sf)	B1
ES0337790028	C	22-07-2010	SYP	A(sf)	A(sf)	A

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.3

Denominación del Fondo: FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS Denominación del compartimento: Denominación de la gestora: GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A. Estados agregados: No Periodo: 2º Semestre Ejercicio: 2011

INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS <i>(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)</i>		Situación actual 31/12/2011		Situación cierre anual anterior 31/12/2010
---	--	--	--	---

1. Importe del Fondo de Reserva	0010	130.000	1010	130.000
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020	2,21	1020	2,06
3. Exceso de spread (%) (1)	0040	0,55	1040	0,38
4. Permuta financiera de intereses (S/N)	0050	Si	1050	Si
5. Permuta financiera de tipos de cambio (S/N)	0070	No	1070	No
6. Otras permutas financieras (S/N)	0080	No	1080	No
7. Importe disponible de la línea/s de liquidez (2)	0090	0	1090	
8. Subordinación de series (S/N)	0110	Si	1110	Si
9. Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total de bonos (3)	0120	93,42	1120	93,87
10. Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales	0150		1150	
11. Porcentaje que representa el aval sobre el total de los pasivos emitidos	0160		1160	
12. Importe máximo de riesgo cubierto por derivados de crédito u otras garantías financieras adquiridas	0170		1170	
13. Otros (S/N) (4)	0180	No	1180	No

(1) Diferencial existente entre los tipos de interés medios ponderados percibidos de la cartera de activos titulizados conforme se establece en el Cuadro 5.5.E y el tipo de interés medio de los pasivos emitidos cuya finalidad ha sido la adquisición de los activos

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

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

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

Información sobre contrapartes de las mejoras crediticias		NIF		Denominación
Contraparte del Fondo de Reserva u otras mejoras equivalentes (5)	0200		1210	CAIXABANK, S.A.
Permutas financieras de tipos de interés	0210		1220	CAIXABANK, S.A.
Permutas financieras de tipos de cambio	0220		1230	
Otras permutas financieras	0230		1240	
Contraparte de la Línea de Liquidez	0240		1250	
Entidad Avalista	0250		1260	
Contraparte del derivado de crédito	0260		1270	

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.4

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

CIRCUNSTANCIAS ESPECÍFICAS ESTABLECIDAS CONTRACTUALMENTE EN EL FONDO

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

Concepto (1)	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio (2)				Ref. Folleto		
					Situación actual		Periodo anterior		Situación actual		Periodo anterior			Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	0010	0	0030	90	0100	10.491	0200	1.135	0300	0,18	0400	0,02	1120	0,18	
2. Activos Morosos por otras razones					0110	581	0210	207	0310	0,01	0410	0,00	1130	0,01	
Total Morosos					0120	11.072	0220	1.342	0320	0,19	0420	0,02	1140	0,19	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050		0060	0	0130	1.094	0230	0	0330	0,02	0430	0,00	1050	0,01	
4. Activos Fallidos por otras razones					0140	640	0240	0	0340	0,01	0440	0,00	1160	0,01	
Total Fallidos					0150	1.734	0250	0	0350	0,03	0450	0,00	1200	0,02	1290

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

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

Otros ratios relevantes	Ratio (2)				Ref. Folleto
	Situación actual	periodo anterior	Última Fecha Pago		
n/a	0160	0260	0360	0460	

TRIGGERS (3)	Límite	% Actual	Última Fecha		Ref. Folleto
			Pago		
Amortización secuencial: series (4)	0500	0520	0540		0560
Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)	0506	0526	0546		0566
OTROS TRIGGERS (3)	0513	0523	0553		0573

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

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

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

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

RATIO DE MOROSIDAD = (Principal Pendiente de Vencer Moroso + Principal Vencido No Cobrado Moroso) / (Saldo Vivo Pendiente de los Activos)

RATIO FALLIDOS = (Importe Neto de los Fallidos) / (Saldo Vivo Pendiente de los Activos)

SALDO VIVO DE LOS ACTIVOS = (Saldo Principal Pendiente de Vencer + Saldo Vencido no Cobrado)

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

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

CUADRO A Distribución geográfica de activos titulizados	Situación actual 31/12/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 22/07/2010			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)		
Andalucía	0400	8.368	0426	801.778	0452	8.502	0478	852.961	0504	8.565	0530	876.926
Aragón	0401	766	0427	82.411	0453	779	0479	88.654	0505	787	0531	91.676
Asturias	0402	435	0428	41.893	0454	441	0480	44.692	0506	444	0532	46.013
Baleares	0403	2.307	0429	278.905	0455	2.371	0481	298.830	0507	2.388	0533	307.117
Canarias	0404	1.261	0430	131.541	0456	1.276	0482	138.595	0508	1.288	0534	142.546
Cantabria	0405	612	0431	61.453	0457	622	0483	65.482	0509	629	0535	67.715
Castilla-León	0406	1.417	0432	135.797	0458	2.357	0484	251.855	0510	1.444	0536	149.148
Castilla La Mancha	0407	2.337	0433	239.513	0459	1.436	0485	144.829	0511	2.380	0537	258.705
Cataluña	0408	19.365	0434	2.093.426	0460	19.810	0486	2.255.871	0512	19.952	0538	2.323.314
Ceuta	0409	31	0435	2.892	0461	32	0487	3.224	0513	33	0539	3.413
Extremadura	0410	577	0436	51.706	0462	587	0488	55.201	0514	591	0540	56.950
Galicia	0411	1.858	0437	177.382	0463	1.887	0489	189.263	0515	1.901	0541	194.386
Madrid	0412	7.976	0438	949.469	0464	8.139	0490	1.024.474	0516	8.219	0542	1.061.151
Meilla	0413	13	0439	1.525	0465	13	0491	1.589	0517	14	0543	1.700
Murcia	0414	1.636	0440	161.663	0466	1.652	0492	170.250	0518	1.663	0544	174.504
Navarra	0415	675	0441	72.300	0467	686	0493	78.481	0519	689	0545	81.207
La Rioja	0416	198	0442	19.824	0468	200	0494	21.308	0520	200	0546	21.852
Comunidad Valenciana	0417	4.232	0443	415.817	0469	4.289	0495	439.734	0521	4.316	0547	451.162
País Vasco	0418	1.480	0444	167.103	0470	1.516	0496	182.889	0522	1.535	0548	190.513
Total España	0419	55.544	0445	5.886.398	0471	56.595	0497	6.308.182	0523	57.038	0549	6.499.998
Otros países Unión europea	0420		0446		0472		0498		0524		0550	
Resto	0422		0448		0474		0500		0526		0552	
Total general	0425	55.544	0450	5.886.398	0475	56.595	0501	6.308.182	0527	57.038	0553	6.499.998

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

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

CUADRO B

Divisa/Activos titulados	Situación actual 31/12/2011						Situación cierre anual anterior 31/12/2010						Situación inicial 22/07/2010					
	Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)	
Euro - EUR	0571	55.544	0577		0583	5.886.398	0600	56.595	0606		0611	6.308.182	0620	57.038	0626		0631	6.500.000
EEUU Dólar - USD	0572		0578		0584		0601		0607		0612		0621		0627		0632	
Japón Yen - JPY	0573		0579		0585		0602		0608		0613		0622		0628		0633	
Reino Unido Libra - GBP	0574		0580		0586		0603		0609		0614		0623		0629		0634	
Otras	0575				0587		0604				0615		0624				0635	
Total	0576	55.544			0588	5.886.398	0605	56.595			0616	6.308.182	0625	57.038			0636	6.500.000

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

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

CUADRO C

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (1)	Situación actual 31/12/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 22/07/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	1100	21.841	1110	2.040.873	1120	18.274	1130	1.838.121	1140	17.386	1150	1.805.398
40% - 60%	1101	22.748	1111	2.598.269	1121	23.442	1131	2.756.779	1141	23.576	1151	2.816.628
60% - 80%	1102	10.334	1112	1.175.630	1122	13.943	1132	1.606.896	1142	15.007	1152	1.753.950
80% - 100%	1103	602	1113	69.699	1123	903	1133	102.774	1143	1.023	1153	119.031
100% - 120%	1104	14	1114	1.514	1124	24	1134	2.729	1144	37	1154	4.096
120% - 140%	1105	2	1115	167	1125	5	1135	562	1145	5	1155	571
140% - 160%	1106	2	1116	187	1126	3	1136	261	1146	3	1156	263
superior al 160%	1107	1	1117	59	1127	1	1137	61	1147	1	1157	62
Total	1108	55.544	1118	5.886.398	1128	56.595	1138	6.308.183	1148	57.038	1158	6.499.999
Media ponderada (%)			1119	47,51			1139	50,03			1159	50,75

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

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

CUADRO D

Rendimiento índice del periodo	Número de activos		Principal Pendiente		Margen ponderado s/ índice de referencia		Tipo de interés medio ponderado (2)	
	vivos							
Índice de referencia (1)	1400		1410		1420		1430	
EURIBOR - A LAS 11 HORAS	17		1.519		0,86		2,49	
EURIBOR OFICIAL	47.297		5.114.040		0,84		2,74	
I.R.P.H. CAJAS	7.758		733.791		0,09		3,43	
MIBOR (IND.OFIC)	97		7.158		0,94		2,81	
MIBOR(IND.OF. NO EURIBOR)	372		29.619		0,96		2,72	
TIPO FIJO	2		202		0,00		5,69	
VPO MFOMENTO 2002/05	1		69		0,00		2,54	
Total	1405	55.544	1415	5.886.398	1425	0,75	1435	2,83

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2011

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

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

CUADRO E Tipo de interés nominal	Situación actual 31/12/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 22/07/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior al 1%	1500		1521		1542		1563		1584	1	1605	115
1% - 1,49%	1501		1522		1543	27	1564	3.242	1585	23	1606	2.760
1,5% - 1,99%	1502	461	1523	56.580	1544	18.513	1565	2.316.126	1586	18.598	1607	2.356.419
2% - 2,49%	1503	11.331	1524	1.289.140	1545	26.871	1566	2.865.794	1587	25.469	1608	2.801.292
2,5% - 2,99%	1504	25.043	1525	2.737.445	1546	3.819	1567	394.380	1588	3.272	1609	347.153
3% - 3,49%	1505	13.603	1526	1.322.183	1547	5.452	1568	539.089	1589	6.113	1610	632.647
3,5% - 3,99%	1506	4.521	1527	419.836	1548	1.435	1569	134.789	1590	2.720	1611	263.519
4% - 4,49%	1507	552	1528	57.344	1549	415	1570	47.782	1591	522	1612	60.629
4,5% - 4,99%	1508	22	1529	2.492	1550	27	1571	2.767	1592	76	1613	8.252
5% - 5,49%	1509	6	1530	786	1551	13	1572	1.762	1593	63	1614	7.112
5,5% - 5,99%	1510	2	1531	219	1552	5	1573	779	1594	23	1615	2.854
6% - 6,49%	1511	2	1532	312	1553	8	1574	869	1595	76	1616	8.689
6,5% - 6,99%	1512	1	1533	61	1554	7	1575	509	1596	62	1617	6.308
7% - 7,49%	1513		1534		1555	3	1576	295	1597	19	1618	1.953
7,5% - 7,99%	1514		1535		1556		1577		1598	1	1619	300
8% - 8,49%	1515		1536		1557		1578		1599		1620	
8,5% - 8,99%	1516		1537		1558		1579		1600		1621	
9% - 9,49%	1517		1538		1559		1580		1601		1622	
9,5% - 9,99%	1518		1539		1560		1581		1602		1623	
Superior al 10%	1519		1540		1561		1582		1603		1624	
Total	1520	55.544	1541	5.886.398	1562	56.595	1583	6.308.183	1604	57.038	1625	6.500.002
Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)			9542	2,83			9584	2,26			1626	2,31
Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)			9543	2,28			9585				1627	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

CUADRO F

Concentración	Situación actual 31/12/2011			Situación cierre anual anterior 31/12/2010			Situación inicial 22/07/2010		
	Porcentaje		CNAE (2)	Porcentaje		CNAE (2)	Porcentaje		CNAE (2)
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	0,25		2030	0,24		2060	0,24	
Sector: (1)	2010	100,0	99 Actividades de organizaciones y organ	2040	100,0	99 Actividades de organizaciones y organ	2070	99,99	2080
		0			0				

(1) Indíquese denominación del sector con mayor concentración

(2) Incluir código CNAE con dos niveles de agregación

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

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

CUADRO G

Divisa/Pasivos emitidos por el fondo	Situación actual 31/12/2011						Situación inicial 22/07/2010					
	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros		Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros	
Euro - EUR	3000	65.000	3060		3110	5.929.355	3170	65.000	3230		3250	6.500.000
EEUU Dólar - USDR	3010		3070		3120		3180		3240		3260	
Japón Yen - JPY	3020		3080		3130		3190		3250		3270	
Reino Unido Libra - GBP	3030		3090		3140		3200		3260		3280	
Otras	3040				3150		3210				3290	
Total	3050	65.000			3160	5.929.355	3220	65.000			3300	6.500.000

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.06

Denominación del Fondo: **FONCAIXA HIPOTECARIO 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **GESTICAIXA, S.G.F.T., S.A.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

Según establece la Norma 28ª de la Circular 2/2009 de la CNMV, se remitirán las cuentas anuales, junto con los informes de gestión y auditoría, a la misma CNMV dentro de los 4 primeros meses del ejercicio siguiente.