

Bonos Titulización de Activos SERIE A1

Número de Bonos:		1.600											
Código ISIN:		ES0345783007											
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			
15/07/2005	2,1980%	555,61 €	472,27 €	888.976,00 €	0,00	100.000,00 €	0,00 €	0,00%	160.000.000,00 €	0,00 €	160.000.000,00 €	160.000.000,00 €	0,00 €
15/04/2005	2,2040%	538,76 €	457,95 €	862.016,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	160.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/01/2005	2,2080%	576,53 €	490,05 €	922.448,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	160.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2004	2,1940%	749,62 €	637,18 €	1.199.392,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	160.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
14/06/2004							100.000,00 €			160.000.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos SERIE A2

Número de Bonos:		11.483											
Código ISIN:		ES0345783015											
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			
17/10/2011	1,7750%	172,21 €	139,49 €	1.977.487,43 €	0,00	555,60 €	36.601,65 €	36,60%	6.379.954,80 €	420.296.746,95 €	6.379.954,80 €	6.379.954,80 €	0,00 €
15/07/2011	1,4970%	143,14 €	115,94 €	1.643.676,62 €	0,00	670,38 €	37.157,25 €	37,16%	7.697.973,54 €	426.676.701,75 €	7.697.973,54 €	7.697.973,54 €	0,00 €
15/04/2011	1,1680%	109,95 €	89,06 €	1.262.555,85 €	0,00	682,19 €	37.827,63 €	37,83%	7.833.587,77 €	434.374.675,29 €	7.833.587,77 €	7.833.587,77 €	0,00 €
17/01/2011	1,1550%	119,34 €	96,67 €	1.370.381,22 €	0,00	1.060,72 €	38.509,82 €	38,51%	12.180.247,76 €	442.208.263,06 €	12.180.247,76 €	12.180.247,76 €	0,00 €
15/10/2010	1,0050%	104,31 €	84,49 €	1.197.791,73 €	0,00	1.042,42 €	39.570,54 €	39,57%	11.970.108,86 €	454.388.510,82 €	11.970.108,86 €	11.970.108,86 €	0,00 €
15/07/2010	0,8140%	85,74 €	69,45 €	984.552,42 €	0,00	1.056,19 €	40.612,96 €	40,61%	12.128.229,77 €	466.358.619,68 €	12.128.229,77 €	12.128.229,77 €	0,00 €
15/04/2010	0,8540%	91,29 €	73,94 €	1.048.283,07 €	0,00	1.089,61 €	41.669,15 €	41,67%	12.511.991,63 €	478.486.849,45 €	12.511.991,63 €	12.511.991,63 €	0,00 €
15/01/2010	0,9120%	102,58 €	83,09 €	1.177.926,14 €	0,00	1.256,24 €	42.758,76 €	42,76%	14.425.403,92 €	490.998.841,08 €	14.425.403,92 €	14.425.403,92 €	0,00 €
15/10/2009	1,1660%	134,35 €	110,17 €	1.542.741,05 €	0,00	1.070,75 €	44.015,00 €	44,02%	12.295.422,25 €	505.424.245,00 €	12.295.422,25 €	12.295.422,25 €	0,00 €
15/07/2009	1,6050%	189,55 €	155,43 €	2.176.602,65 €	0,00	1.634,95 €	45.085,75 €	45,09%	18.774.130,85 €	517.719.667,25 €	18.774.130,85 €	18.774.130,85 €	0,00 €
15/04/2009	2,7820%	333,92 €	273,81 €	3.834.403,36 €	0,00	1.290,11 €	46.720,70 €	46,72%	14.814.333,13 €	536.493.798,10 €	14.814.333,13 €	14.814.333,13 €	0,00 €
15/01/2009	5,4880%	687,27 €	563,56 €	7.891.921,41 €	0,00	993,07 €	48.010,81 €	48,01%	11.403.422,81 €	551.308.131,23 €	11.403.422,81 €	11.403.422,81 €	0,00 €
15/10/2008	5,1330%	657,13 €	538,85 €	7.545.823,79 €	0,00	1.091,29 €	49.003,88 €	49,00%	12.531.283,07 €	562.711.554,04 €	12.531.283,07 €	12.531.283,07 €	0,00 €
15/07/2008	4,9170%	640,52 €	525,23 €	7.355.091,16 €	0,00	1.438,52 €	50.095,17 €	50,10%	16.518.525,16 €	575.242.837,11 €	16.518.525,16 €	16.518.525,16 €	0,00 €
15/04/2008	4,7460%	633,70 €	519,63 €	7.276.777,10 €	0,00	1.288,62 €	51.533,69 €	51,53%	14.797.223,46 €	591.761.362,27 €	14.797.223,46 €	14.797.223,46 €	0,00 €
15/01/2008	4,9020%	685,11 €	561,79 €	7.867.118,13 €	0,00	1.866,82 €	52.822,31 €	52,82%	21.436.694,06 €	606.558.585,73 €	21.436.694,06 €	21.436.694,06 €	0,00 €
15/10/2007	4,3790%	625,53 €	512,93 €	7.182.960,99 €	0,00	1.822,38 €	54.689,13 €	54,69%	20.926.389,54 €	627.995.279,79 €	20.926.389,54 €	20.926.389,54 €	0,00 €
16/07/2007	4,1380%	619,63 €	508,10 €	7.115.211,29 €	0,00	2.726,79 €	56.511,51 €	56,51%	31.311.729,57 €	648.921.669,33 €	31.311.729,57 €	31.311.729,57 €	0,00 €
16/04/2007	3,9270%	619,22 €	507,76 €	7.110.503,26 €	0,00	3.141,98 €	59.238,30 €	59,24%	36.079.356,34 €	680.233.398,90 €	36.079.356,34 €	36.079.356,34 €	0,00 €
15/01/2007	3,6640%	613,80 €	503,32 €	7.048.265,40 €	0,00	3.891,71 €	62.380,28 €	62,38%	44.688.505,93 €	716.312.755,24 €	44.688.505,93 €	44.688.505,93 €	0,00 €
16/10/2006	3,2600%	575,19 €	488,91 €	6.604.906,77 €	0,00	3.528,22 €	66.271,99 €	66,27%	40.514.550,26 €	761.001.261,17 €	40.514.550,26 €	40.514.550,26 €	0,00 €
17/07/2006	2,9340%	548,88 €	466,55 €	6.302.789,04 €	0,00	5.029,49 €	69.800,21 €	69,80%	57.753.633,67 €	801.515.811,43 €	57.753.633,67 €	57.753.633,67 €	0,00 €
18/04/2006	2,6840%	552,48 €	469,61 €	6.344.127,84 €	0,00	5.717,08 €	74.829,70 €	74,83%	65.649.229,64 €	859.269.445,10 €	65.649.229,64 €	65.649.229,64 €	0,00 €
16/01/2006	2,3550%	595,29 €	506,00 €	6.835.715,07 €	0,00	19.453,22 €	80.546,78 €	80,55%	223.381.325,26 €	924.918.674,74 €	223.381.325,26 €	223.381.325,26 €	0,00 €
17/10/2005	2,2890%	597,68 €	508,03 €	6.863.159,44 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	1.148.300.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/07/2005	2,3080%	583,41 €	495,90 €	6.699.297,03 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	1.148.300.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/04/2005	2,3140%	565,64 €	480,79 €	6.495.244,12 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	1.148.300.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/01/2005	2,3180%	605,26 €	514,47 €	6.950.200,58 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	1.148.300.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2004	2,3040%	787,20 €	669,12 €	9.039.417,60 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	1.148.300.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €

Bonos Titulización de Activos SERIE A2

14/06/2004

100.000,00 €

1.148.300.000,00 €

Bonos Titulización de Activos SERIE B

Número de Bonos:		217											
Código ISIN:		ES0345783023											
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			
17/10/2011	1,8550%	375,90 €	304,48 €	81.570,30 €	0,00	1.160,56 €	76.447,75 €	76,45%	251.841,52 €	16.589.161,75 €	251.841,52 €	251.841,52 €	0,00 €
15/07/2011	1,5770%	314,95 €	255,11 €	68.344,15 €	0,00	1.400,23 €	77.608,31 €	77,61%	303.849,91 €	16.841.003,27 €	303.849,91 €	303.849,91 €	0,00 €
15/04/2011	1,2480%	241,03 €	195,23 €	52.303,51 €	0,00	0,00 €	79.008,54 €	79,01%	0,00 €	17.144.853,18 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/01/2011	1,2350%	254,78 €	206,37 €	55.287,26 €	0,00	0,00 €	79.008,54 €	79,01%	0,00 €	17.144.853,18 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2010	1,0850%	219,07 €	177,45 €	47.538,19 €	0,00	0,00 €	79.008,54 €	79,01%	0,00 €	17.144.853,18 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/07/2010	0,8940%	183,19 €	148,38 €	39.752,23 €	0,00	2.054,85 €	79.008,54 €	79,01%	445.902,45 €	17.144.853,18 €	445.902,45 €	445.902,45 €	0,00 €
15/04/2010	0,9340%	194,23 €	157,33 €	42.147,91 €	0,00	2.119,81 €	81.063,39 €	81,06%	459.998,77 €	17.590.755,63 €	459.998,77 €	459.998,77 €	0,00 €
15/01/2010	0,9920%	217,07 €	175,83 €	47.104,19 €	0,00	2.443,92 €	83.183,20 €	83,18%	530.330,64 €	18.050.754,40 €	530.330,64 €	530.330,64 €	0,00 €
15/10/2009	1,2460%	279,29 €	229,02 €	60.605,93 €	0,00	2.083,04 €	85.627,12 €	85,63%	452.019,68 €	18.581.085,04 €	452.019,68 €	452.019,68 €	0,00 €
15/07/2009	1,6850%	387,13 €	317,45 €	84.007,21 €	0,00	3.180,75 €	87.710,16 €	87,71%	690.222,75 €	19.033.104,72 €	690.222,75 €	690.222,75 €	0,00 €
15/04/2009	2,8620%	650,32 €	533,26 €	141.119,44 €	0,00	0,00 €	90.890,91 €	90,89%	0,00 €	19.723.327,47 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/01/2009	5,5680%	1.320,07 €	1.082,46 €	286.455,19 €	0,00	1.880,09 €	90.890,91 €	90,89%	407.979,53 €	19.723.327,47 €	407.979,53 €	407.979,53 €	0,00 €
15/10/2008	5,2130%	1.263,43 €	1.036,01 €	274.164,31 €	0,00	2.066,08 €	92.771,00 €	92,77%	448.339,36 €	20.131.307,00 €	448.339,36 €	448.339,36 €	0,00 €
15/07/2008	4,9970%	1.232,32 €	1.010,50 €	267.413,44 €	0,00	2.723,34 €	94.837,08 €	94,84%	590.964,78 €	20.579.646,36 €	590.964,78 €	590.964,78 €	0,00 €
15/04/2008	4,8260%	1.219,91 €	1.000,33 €	264.720,47 €	0,00	2.439,58 €	97.560,42 €	97,56%	529.388,86 €	21.170.611,14 €	529.388,86 €	529.388,86 €	0,00 €
15/01/2008	4,9820%	1.273,18 €	1.044,01 €	276.280,06 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	21.700.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2007	4,4590%	1.127,14 €	924,25 €	244.589,38 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	21.700.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
16/07/2007	4,2180%	1.066,22 €	874,30 €	231.369,74 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	21.700.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
16/04/2007	4,0070%	1.012,88 €	830,56 €	219.794,96 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	21.700.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/01/2007	3,7440%	946,40 €	776,05 €	205.368,80 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	21.700.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
16/10/2006	3,3400%	844,28 €	717,64 €	183.208,76 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	21.700.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/07/2006	3,0140%	753,50 €	640,48 €	163.509,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	21.700.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
18/04/2006	2,7640%	706,36 €	600,41 €	153.280,12 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	21.700.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
16/01/2006	2,4350%	615,51 €	523,18 €	133.565,67 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	21.700.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/10/2005	2,3690%	618,57 €	525,78 €	134.229,69 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	21.700.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/07/2005	2,3880%	603,63 €	513,09 €	130.987,71 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	21.700.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/04/2005	2,3940%	585,20 €	497,42 €	126.988,40 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	21.700.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/01/2005	2,3980%	626,14 €	532,22 €	135.872,38 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	21.700.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2004	2,3840%	814,53 €	692,35 €	176.753,01 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	21.700.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €

Bonos Titulización de Activos SERIE B

14/06/2004

100.000,00 €

21.700.000,00 €

Bonos Titulación de Activos SERIE C

Número de Bonos:		420											
Código ISIN:		ES0345783031											
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			
17/10/2011	2,0050%	406,30 €	329,10 €	170.646,00 €	0,00	1.160,56 €	76.447,75 €	76,45%	487.435,20 €	32.108.055,00 €	487.435,20 €	487.435,20 €	0,00 €
15/07/2011	1,7270%	344,91 €	279,38 €	144.862,20 €	0,00	1.400,23 €	77.608,31 €	77,61%	588.096,60 €	32.595.490,20 €	588.096,60 €	588.096,60 €	0,00 €
15/04/2011	1,3980%	270,00 €	218,70 €	113.400,00 €	0,00	0,00 €	79.008,54 €	79,01%	0,00 €	33.183.586,80 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/01/2011	1,3850%	285,73 €	231,44 €	120.006,60 €	0,00	0,00 €	79.008,54 €	79,01%	0,00 €	33.183.586,80 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2010	1,2350%	249,36 €	201,98 €	104.731,20 €	0,00	0,00 €	79.008,54 €	79,01%	0,00 €	33.183.586,80 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/07/2010	1,0440%	213,93 €	173,28 €	89.850,60 €	0,00	2.054,85 €	79.008,54 €	79,01%	863.037,00 €	33.183.586,80 €	863.037,00 €	863.037,00 €	0,00 €
15/04/2010	1,0840%	225,43 €	182,60 €	94.680,60 €	0,00	2.119,81 €	81.063,39 €	81,06%	890.320,20 €	34.046.623,80 €	890.320,20 €	890.320,20 €	0,00 €
15/01/2010	1,1420%	249,90 €	202,42 €	104.958,00 €	0,00	2.443,92 €	83.183,20 €	83,18%	1.026.446,40 €	34.936.944,00 €	1.026.446,40 €	1.026.446,40 €	0,00 €
15/10/2009	1,3960%	312,91 €	256,59 €	131.422,20 €	0,00	2.083,04 €	85.627,12 €	85,63%	874.876,80 €	35.963.390,40 €	874.876,80 €	874.876,80 €	0,00 €
15/07/2009	1,8350%	421,59 €	345,70 €	177.067,80 €	0,00	3.180,75 €	87.710,16 €	87,71%	1.335.915,00 €	36.838.267,20 €	1.335.915,00 €	1.335.915,00 €	0,00 €
15/04/2009	3,0120%	684,41 €	561,22 €	287.452,20 €	0,00	0,00 €	90.890,91 €	90,89%	0,00 €	38.174.182,20 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/01/2009	5,7180%	1.355,63 €	1.111,62 €	569.364,60 €	0,00	1.880,09 €	90.890,91 €	90,89%	789.637,80 €	38.174.182,20 €	789.637,80 €	789.637,80 €	0,00 €
15/10/2008	5,3630%	1.299,78 €	1.065,82 €	545.907,60 €	0,00	2.066,08 €	92.771,00 €	92,77%	867.753,60 €	38.963.820,00 €	867.753,60 €	867.753,60 €	0,00 €
15/07/2008	5,1470%	1.269,31 €	1.040,83 €	533.110,20 €	0,00	2.723,34 €	94.837,08 €	94,84%	1.143.802,80 €	39.831.573,60 €	1.143.802,80 €	1.143.802,80 €	0,00 €
15/04/2008	4,9760%	1.257,82 €	1.031,41 €	528.284,40 €	0,00	2.439,58 €	97.560,42 €	97,56%	1.024.623,60 €	40.975.376,40 €	1.024.623,60 €	1.024.623,60 €	0,00 €
15/01/2008	5,1320%	1.311,51 €	1.075,44 €	550.834,20 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	42.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2007	4,6090%	1.165,05 €	955,34 €	489.321,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	42.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
16/07/2007	4,3680%	1.104,13 €	905,39 €	463.734,60 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	42.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
16/04/2007	4,1570%	1.050,79 €	861,65 €	441.331,80 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	42.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/01/2007	3,8940%	984,32 €	807,14 €	413.414,40 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	42.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
16/10/2006	3,4900%	882,19 €	749,86 €	370.519,80 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	42.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/07/2006	3,1640%	791,00 €	672,35 €	332.220,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	42.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
18/04/2006	2,9140%	744,69 €	632,99 €	312.769,80 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	42.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
16/01/2006	2,5850%	653,43 €	555,42 €	274.440,60 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	42.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/10/2005	2,5190%	657,74 €	559,08 €	276.250,80 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	42.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/07/2005	2,5380%	641,55 €	545,32 €	269.451,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	42.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/04/2005	2,5440%	621,87 €	528,59 €	261.185,40 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	42.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/01/2005	2,5480%	665,31 €	565,51 €	279.430,20 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	42.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2004	2,5340%	865,78 €	735,91 €	363.627,60 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	42.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €

Bonos Titulización de Activos SERIE C

14/06/2004

100.000,00 €

42.000.000,00 €

Bonos Titulización de Activos SERIE D

Número de Bonos:		280											
Código ISIN:		ES0345783049											
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			
17/10/2011	2,4050%	487,36 €	394,76 €	136.460,80 €	0,00	1.160,56 €	76.447,75 €	76,45%	324.956,80 €	21.405.370,00 €	324.956,80 €	324.956,80 €	0,00 €
15/07/2011	2,1270%	424,80 €	344,09 €	118.944,00 €	0,00	1.400,23 €	77.608,31 €	77,61%	392.064,40 €	21.730.326,80 €	392.064,40 €	392.064,40 €	0,00 €
15/04/2011	1,7980%	347,25 €	281,27 €	97.230,00 €	0,00	0,00 €	79.008,54 €	79,01%	0,00 €	22.122.391,20 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/01/2011	1,7850%	368,25 €	298,28 €	103.110,00 €	0,00	0,00 €	79.008,54 €	79,01%	0,00 €	22.122.391,20 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2010	1,6350%	330,12 €	267,40 €	92.433,60 €	0,00	0,00 €	79.008,54 €	79,01%	0,00 €	22.122.391,20 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/07/2010	1,4440%	295,89 €	239,67 €	82.849,20 €	0,00	2.054,85 €	79.008,54 €	79,01%	575.358,00 €	22.122.391,20 €	575.358,00 €	575.358,00 €	0,00 €
15/04/2010	1,4840%	308,61 €	249,97 €	86.410,80 €	0,00	2.119,81 €	81.063,39 €	81,06%	593.546,80 €	22.697.749,20 €	593.546,80 €	593.546,80 €	0,00 €
15/01/2010	1,5420%	337,43 €	273,32 €	94.480,40 €	0,00	2.443,92 €	83.183,20 €	83,18%	684.297,60 €	23.291.296,00 €	684.297,60 €	684.297,60 €	0,00 €
15/10/2009	1,7960%	402,57 €	330,11 €	112.719,60 €	0,00	2.083,04 €	85.627,12 €	85,63%	583.251,20 €	23.975.593,60 €	583.251,20 €	583.251,20 €	0,00 €
15/07/2009	2,2350%	513,50 €	421,07 €	143.780,00 €	0,00	3.180,75 €	87.710,16 €	87,71%	890.610,00 €	24.558.844,80 €	890.610,00 €	890.610,00 €	0,00 €
15/04/2009	3,4120%	775,30 €	635,75 €	217.084,00 €	0,00	0,00 €	90.890,91 €	90,89%	0,00 €	25.449.454,80 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/01/2009	6,1180%	1.450,46 €	1.189,38 €	406.128,80 €	0,00	1.880,09 €	90.890,91 €	90,89%	526.425,20 €	25.449.454,80 €	526.425,20 €	526.425,20 €	0,00 €
15/10/2008	5,7630%	1.396,73 €	1.145,32 €	391.084,40 €	0,00	2.066,08 €	92.771,00 €	92,77%	578.502,40 €	25.975.880,00 €	578.502,40 €	578.502,40 €	0,00 €
15/07/2008	5,5470%	1.367,95 €	1.121,72 €	383.026,00 €	0,00	2.723,34 €	94.837,08 €	94,84%	762.535,20 €	26.554.382,40 €	762.535,20 €	762.535,20 €	0,00 €
15/04/2008	5,3760%	1.358,93 €	1.114,32 €	380.500,40 €	0,00	2.439,58 €	97.560,42 €	97,56%	683.082,40 €	27.316.917,60 €	683.082,40 €	683.082,40 €	0,00 €
15/01/2008	5,5320%	1.413,73 €	1.159,26 €	395.844,40 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	28.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2007	5,0090%	1.266,16 €	1.038,25 €	354.524,80 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	28.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
16/07/2007	4,7680%	1.205,24 €	988,30 €	337.467,20 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	28.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
16/04/2007	4,5570%	1.151,90 €	944,56 €	322.532,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	28.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/01/2007	4,2940%	1.085,43 €	890,05 €	303.920,40 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	28.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
16/10/2006	3,8900%	983,31 €	835,81 €	275.326,80 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	28.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/07/2006	3,5640%	891,00 €	757,35 €	249.480,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	28.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
18/04/2006	3,3140%	846,91 €	719,87 €	237.134,80 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	28.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
16/01/2006	2,9850%	754,54 €	641,36 €	211.271,20 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	28.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/10/2005	2,9190%	762,18 €	647,85 €	213.410,40 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	28.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/07/2005	2,9380%	742,66 €	631,26 €	207.944,80 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	28.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/04/2005	2,9440%	719,64 €	611,69 €	201.499,20 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	28.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/01/2005	2,9480%	769,76 €	654,30 €	215.532,80 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	28.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2004	2,9340%	1.002,45 €	852,08 €	280.686,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	28.000.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €

Bonos Titulización de Activos SERIE D

14/06/2004

100.000,00 €

28.000.000,00 €

Clasificación de la cartera por índices a 30/09/2011

Índice (1)			Número PH	%	Principal pendiente	%	Tipo nominal	Margen s/ Referencia	Principal/ Tasación	Vida residual	
										Meses	Fecha
Índice	CECA	Tipo Activo CECA	24	0,372208%	753.690,41	0,154264%	5,163452%	0,254857	54,680736	150,320234	09/04/2024
Índice	ER1A	Euribor 1 año	2.630	40,787841%	227.171.069,43	46,497014%	2,640096%	0,886515	61,036772	228,804601	24/10/2030
Índice	IRPC	Préstamos Hipotecarios Cajas	252	3,908189%	10.023.914,18	2,051679%	3,671051%	0,521147	60,814893	168,790606	24/10/2025
Índice	MB1A	Mibor 1 Año	123	1,907568%	4.032.405,51	0,825346%	2,833064%	1,040264	49,512204	139,049192	02/05/2023
Índice	TAE1	Préstamos Hipotecarios Cajas TAE	3.418	53,008685%	246.564.093,60	50,466348%	3,409808%	0,223463	71,122717	232,895635	26/02/2031
Índice	TAE3	Tipo Activo C.E.C.A TAE	1	0,015509%	26.131,41	0,005349%	5,375000%	0,250000	41,543117	242,004107	30/11/2031
Total CatalunyaCaixa			6.448	100%	488.571.304,54	100%	3,055325%	0,544661	66,016263	228,776742	23/10/2030
Total cartera			6.448	100%	488.571.304,54	100%					
Media ponderada:							3,055325	0,544661	66,016263	228,776742	23/10/2030
Media simple:							75.770,98	3,111134	0,531361	60,066565	208,307713
Mínimo:							422,18	1,691000	-0,500000	0,260233	2,004107
Máximo:							365.550,11	5,500000	3,000000	99,535854	267,039014

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

Clasificación de la cartera por índices a 30/09/2011

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	8	20,512821%	840.880,29	24,059015%	2,755138%	1,071923	68,132756	252,175816	05/10/2032	
Índice	IRPC	Préstamos Hipotecarios Cajas	1	2,564103%	39.946,55	1,142939%	4,170000%	0,750000	60,643680	130,004107	31/07/2022	
Índice	TAE1	Préstamos Hipotecarios Cajas TAE	30	76,923077%	2.614.246,75	74,798046%	3,507106%	0,290699	79,717303	244,279345	07/02/2032	
Total CatalunyaCaixa			39	100%	3.495.073,59	100%	3,333767%	0,483903	76,712175	244,873062	25/02/2032	
Total cartera			39	100%	3.495.073,59	100%						
<i>Media ponderada:</i>							3,333767	0,483903	76,712175	244,873062	25/02/2032	
<i>Media simple:</i>							89.617,27	3,384282	0,474359	76,161835	239,521508	15/09/2031
<i>Mínimo:</i>							25.589,02	2,276000	0,100000	29,473209	130,004107	31/07/2022
<i>Máximo:</i>							149.615,26	4,170000	1,500000	95,252743	266,020534	30/11/2033

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 30/09/2011

Situación: Regular
 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	178	35.487,80	14.384,81	49.872,61	37,54%	14.308.746,86	67,13%	14.344.234,66	67,03%	14.358.619,47	21.950.345,85	65,3486%	65,4141%
De 1 a 2 Meses	63	30.472,23	17.901,17	48.373,40	36,41%	4.700.486,19	22,05%	4.730.958,42	22,11%	4.748.859,59	7.415.343,66	63,7996%	64,0410%
De 2 a 3 Meses	23	19.428,10	15.177,75	34.605,85	26,05%	2.304.612,27	10,81%	2.324.040,37	10,86%	2.339.218,12	2.997.601,59	77,5300%	78,0363%
Total cedente:	264	85.388,13	47.463,73	132.851,86	100%	21.313.845,32	100%	21.399.233,45	100%	21.446.697,18	32.363.291,10	66,1219%	66,2686%
Total listado:	264	85.388,13	47.463,73	132.851,86	100%	21.313.845,32	100%	21.399.233,45	100%	21.446.697,18	32.363.291,10	66,1219%	66,2686%

Clasificación de los impagados desde primera cuota vencida a 30/09/2011

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	1	215,96	0,00	215,96	0,16%	64.058,80	1,83%	64.274,76	1,79%	64.274,76	81.832,47	78,5443%	78,5443%
De 3 a 6 Meses	16	21.129,70	11.555,36	32.685,06	24,03%	1.314.111,38	37,60%	1.335.241,08	37,14%	1.346.796,44	1.810.383,94	73,7546%	74,3929%
De 6 a 12 Meses	12	32.429,95	12.593,10	45.023,05	33,10%	1.079.780,46	30,89%	1.112.210,41	30,94%	1.124.803,51	1.834.230,74	60,6363%	61,3229%
De 12 Meses a 2 Años	11	46.038,02	12.076,00	58.114,02	42,72%	1.037.122,95	29,67%	1.083.160,97	30,13%	1.095.236,97	1.260.588,44	85,9250%	86,8830%
Total cedente:	40	99.813,63	36.224,46	136.038,09	100%	3.495.073,59	100%	3.594.887,22	100%	3.631.111,68	4.987.035,59	72,0847%	72,8110%
Total listado:	40	99.813,63	36.224,46	136.038,09	100%	3.495.073,59	100%	3.594.887,22	100%	3.631.111,68	4.987.035,59	72,0847%	72,8110%

Clasificación de los impagados por antigüedad a 30/09/2011

Antigüedad de la deuda	Cuotas	Principal	% Principal	Intereses	% Intereses	Comisiones	Demora	Total deuda	% no cobrada
CatalunyaCaixa									
Hasta 1 Mes	264	59.759,34	69,99%	33.377,81	70,32%	0,00	0,00	93.137,15	70,11%
De 1 a 2 Meses	86	19.593,55	22,95%	11.382,86	23,98%	0,00	0,00	30.976,41	23,32%
De 2 a 3 Meses	23	6.035,24	7,07%	2.703,06	5,70%	0,00	0,00	8.738,30	6,58%
Total cedente:	373	85.388,13	100,00%	47.463,73	100,00%	0,00	0,00	132.851,86	100,00%
Total listado:	373	85.388,13	100,00%	47.463,73	100,00%	0,00	0,00	132.851,86	100,00%

Clasificación de los impagados por antigüedad a 30/09/2011

Antigüedad de la deuda	Cuotas	Principal	% Principal	Intereses	% Intereses	Comisiones	Demora	Total deuda	% no cobrada
CatalunyaCaixa									
Hasta 1 Mes	78	20.519,63	20,56%	1.840,89	5,08%	0,00	0,00	22.360,52	16,44%
De 1 a 2 Meses	39	10.136,82	10,16%	2.916,37	8,05%	0,00	0,00	13.053,19	9,60%
De 2 a 3 Meses	39	9.710,51	9,73%	3.860,79	10,66%	0,00	0,00	13.571,30	9,98%
De 3 a 6 Meses	95	23.866,96	23,91%	8.756,83	24,17%	0,00	0,00	32.623,79	23,98%
De 6 a 12 Meses	101	26.673,25	26,72%	10.037,53	27,71%	0,00	0,00	36.710,78	26,99%
De 12 Meses a 2 Años	35	8.906,46	8,92%	8.812,05	24,33%	0,00	0,00	17.718,51	13,02%
Total cedente:	387	99.813,63	100,00%	36.224,46	100,00%	0,00	0,00	136.038,09	100,00%
Total listado:	387	99.813,63	100,00%	36.224,46	100,00%	0,00	0,00	136.038,09	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
08/06/2004	1.400.000.185,36	100,000000%	0,00										
30/06/2004	1.386.717.031,46	99,051203%	10.390.440,48	0,74217422%	8,55139308%							0,96695813%	11,00585663%
31/07/2004	1.363.080.878,00	97,362907%	20.876.205,34	1,50544090%	16,64207686%							1,27034218%	14,22285608%
31/08/2004	1.350.341.236,34	96,452933%	9.973.788,81	0,73170925%	8,43562638%							1,07490525%	12,16295870%
30/09/2004	1.335.588.543,81	95,399169%	12.012.927,91	0,88962164%	10,16830200%	1,04112304%	11,80233315%					1,02428743%	11,62210660%
31/10/2004	1.318.575.058,38	94,183920%	14.279.051,95	1,06912058%	12,10130327%	0,89484136%	10,22505813%					1,03183574%	11,70295356%
30/11/2004	1.298.338.658,85	92,738463%	17.538.294,06	1,33009448%	14,84374609%	1,09387755%	12,36489499%					1,08121073%	12,23011983%
31/12/2004	1.277.356.484,30	91,239737%	18.317.596,80	1,41084891%	15,67632509%	1,26724854%	14,19059706%	1,15029889%	12,96291738%			1,12735706%	12,72020449%
31/01/2005	1.263.822.981,98	90,273058%	10.863.457,28	0,85046402%	9,74147487%	1,19528665%	13,43706952%	1,04141600%	11,80546631%			1,09012690%	12,32500774%
28/02/2005	1.243.294.100,97	88,806710%	17.894.975,22	1,41594001%	15,72856348%	1,22353148%	13,73354703%	1,15484939%	13,01098565%			1,12458422%	12,69082733%
31/03/2005	1.218.375.654,55	87,026821%	22.341.197,97	1,79693589%	19,55473904%	1,35166106%	15,06683206%	1,30514677%	14,58501551%			1,19005140%	13,38201420%
30/04/2005	1.195.650.731,92	85,403612%	20.179.457,18	1,65625906%	18,16092823%	1,61955018%	17,79359677%	1,40243712%	15,58994897%			1,23007990%	13,80215081%
31/05/2005	1.173.760.367,78	83,840015%	19.362.199,27	1,61938589%	17,79194937%	1,68742395%	18,47160155%	1,45027272%	16,08006842%			1,25987997%	14,11371656%
30/06/2005	1.150.335.805,05	82,166832%	20.959.271,70	1,78565168%	19,44374425%	1,68341448%	18,43169303%	1,51216612%	16,71035146%	1,32144824%	14,75415812%	1,29741121%	14,50464441%
31/07/2005	1.125.747.653,21	80,410536%	22.124.391,29	1,92329850%	20,78813921%	1,77213620%	19,31061742%	1,69005430%	18,49777315%	1,35502395%	15,10156974%	1,33889824%	14,93487748%
31/08/2005	1.108.943.118,64	79,210212%	14.372.898,22	1,27674245%	14,28955958%	1,65906765%	18,18897063%	1,66778512%	18,27595430%	1,40047812%	15,56982140%	1,33193111%	14,86276519%
30/09/2005	1.089.060.805,51	77,790047%	17.485.056,24	1,57673157%	17,36321827%	1,58937624%	17,49052683%	1,631115158%	17,90985048%	1,45726774%	16,15151973%	1,34402296%	14,98788445%
31/10/2005	1.068.170.043,68	76,297850%	18.502.801,91	1,69896867%	18,58641273%	1,51398539%	16,72881198%	1,63809430%	17,97934905%	1,50920028%	16,68024856%	1,36145697%	15,16798459%
30/11/2005	1.045.638.690,21	74,688468%	20.166.855,30	1,88798173%	20,44517653%	1,71725576%	18,76797277%	1,68240403%	18,42163262%	1,55487013%	17,14268899%	1,38691073%	15,43030373%
31/12/2005	1.018.903.678,69	72,778825%	24.310.259,59	2,32491967%	24,59410052%	1,96605261%	21,20151253%	1,77121248%	19,30151144%	1,62951148%	17,89342474%	1,43177567%	15,89085941%
31/01/2006	1.000.297.438,77	71,449808%	16.325.345,77	1,60224623%	17,61991924%	1,93458761%	20,89748206%	1,71787810%	18,77414505%	1,69200791%	18,51720636%	1,43667228%	15,94098555%
28/02/2006	979.871.207,25	69,990791%	18.180.787,46	1,81753814%	19,75702706%	1,91127190%	20,67150084%	1,80768912%	19,66038035%	1,72512077%	18,84594496%	1,45075283%	16,08497424%
31/03/2006	955.500.338,04	68,250015%	22.157.669,25	2,26128384%	24,00245537%	1,88921737%	20,45719878%	1,92091093%	20,76499617%	1,76257542%	19,21632235%	1,48270255%	16,41085634%
30/04/2006	935.373.978,81	66,812418%	17.943.029,65	1,87786743%	20,34670567%	1,98112804%	21,34679899%	1,95076651%	21,05394473%	1,78065057%	19,39450706%	1,49552017%	16,54126772%
31/05/2006	916.151.631,54	65,439394%	16.987.062,21	1,81607171%	19,74264400%	1,98100029%	21,34556884%	1,93902210%	20,94039528%	1,79684621%	19,55385740%	1,50455060%	16,63303468%
30/06/2006	898.401.450,91	64,171524%	15.658.615,39	1,70917290%	18,68776936%	1,79692014%	19,55458421%	1,83667499%	19,94450893%	1,79047909%	19,49124519%	1,50855258%	16,67367311%
31/07/2006	878.780.972,18	62,770061%	17.631.492,61	1,96254053%	21,16763030%	1,82479196%	19,82813936%	1,89644401%	20,52747788%	1,79318523%	19,51786202%	1,52124572%	16,80244657%
31/08/2006	866.830.888,69	61,916484%	9.944.679,22	1,13164481%	12,76561375%	1,59847293%	17,58200247%	1,78409735%	19,42844441%	1,78266165%	19,41430998%	1,50384388%	16,62585633%
30/09/2006	855.508.552,65	61,107746%	9.335.771,52	1,07700033%	12,18527906%	1,38873821%	15,44910854%	1,58798580%	17,47653640%	1,74274911%	19,02045954%	1,48575653%	16,44194567%
31/10/2006	839.304.043,39	59,950281%	14.258.427,17	1,66666097%	18,26474218%	1,28871074%	14,41416532%	1,55247122%	17,11845700%	1,74018555%	18,99510254%	1,48775789%	16,46231355%
30/11/2006	824.131.884,34	58,866555%	13.284.979,09	1,58285656%	17,42490808%	1,43876228%	15,96237237%	1,51356568%	16,72455346%	1,71506656%	18,74625727%	1,48684188%	16,45299187%
31/12/2006	811.001.505,75	57,928671%	11.307.523,97	1,37205272%	15,27727186%	1,53726656%	16,96471942%	1,45760699%	16,15498357%	1,63635974%	17,96199063%	1,47952640%	16,37851215%
31/01/2007	798.804.896,47	57,057485%	9.938.566,72	1,22546834%	13,75384361%	1,39066668%	15,46894848%	1,33474583%	14,89190531%	1,60599845%	17,65760837%	1,46832145%	16,26431530%
28/02/2007	785.802.667,25	56,128755%	11.254.381,48	1,40890242%	15,65634480%	1,33220245%	14,86557468%	1,38076567%	15,36704265%	1,57232668%	17,31882691%	1,46276449%	16,20762774%
31/03/2007	774.476.901,15	55,319771%	9.581.968,39	1,21938609%	13,69009248%	1,28123915%	14,33639566%	1,40484759%	15,61470901%	1,48599973%	16,44442091%	1,45231271%	16,10091183%

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
30/04/2007	764.406.037,69	54,600424%	8.370.524,33	1,08079716%	12,22571622%	1,23393718%	13,84253771%	1,30770451%	14,61157476%	1,42045502%	15,77486604%	1,43875495%	15,96229736%
31/05/2007	754.252.346,18	53,875160%	8.478.345,69	1,10914164%	12,52705304%	1,13399297%	12,79047276%	1,22892928%	13,79010012%	1,36234054%	15,17710287%	1,42657833%	15,83762465%
30/06/2007	743.764.187,94	53,126006%	8.845.397,47	1,17273715%	13,19970401%	1,11833635%	12,62460023%	1,19565777%	13,44097111%	1,31801817%	14,71859351%	1,41652512%	15,73456525%
31/07/2007	735.216.536,59	52,515460%	6.926.839,17	0,93132195%	10,62080998%	1,06887556%	12,09869087%	1,14779959%	12,93650610%	1,23265255%	13,82908917%	1,40119777%	15,57721591%
31/08/2007	727.969.246,60	51,997796%	5.645.328,20	0,76784565%	8,83481011%	0,95562833%	10,88360406%	1,04160156%	11,80745085%	1,20353546%	13,52375126%	1,38284159%	15,38841837%
30/09/2007	721.471.777,35	51,533692%	4.934.854,58	0,67789328%	7,83817339%	0,79085144%	9,08811367%	0,95206246%	10,84509517%	1,17165633%	13,18831190%	1,36335046%	15,18752395%
31/10/2007	713.635.311,59	50,973944%	6.302.037,88	0,87349749%	9,99276961%	0,77134249%	8,87335345%	0,91763120%	10,47247664%	1,10611911%	12,49496506%	1,34900928%	15,03943081%
30/11/2007	706.777.038,69	50,484068%	5.317.967,88	0,74519405%	8,58477437%	0,76385839%	8,79084292%	0,85723704%	9,81543506%	1,03700498%	11,75828015%	1,33258807%	14,86956735%
31/12/2007	699.362.003,98	49,954422%	5.877.573,76	0,83160225%	9,53521457%	0,81504555%	9,35380502%	0,80024175%	9,19131945%	0,99233403%	11,27911414%	1,31866098%	14,72525950%
31/01/2008	694.061.616,77	49,575823%	3.807.361,99	0,54440504%	6,34075832%	0,70574261%	8,14779522%	0,73622411%	8,48558763%	0,93714048%	10,68378289%	1,29957308%	14,52711281%
29/02/2008	688.538.302,08	49,181301%	3.999.961,31	0,57631213%	6,70069305%	0,64962418%	7,52290660%	0,70462790%	8,13542043%	0,86841504%	9,93737536%	1,28192621%	14,34354974%
31/03/2008	683.266.173,78	48,804720%	3.843.317,41	0,55818498%	6,49636177%	0,55841095%	6,49891141%	0,68497406%	7,91698628%	0,81394421%	9,34172595%	1,26467123%	14,16371371%
30/04/2008	675.744.591,34	48,267464%	6.063.367,92	0,88740935%	10,14423690%	0,67239829%	7,77696860%	0,68685784%	7,93794341%	0,79766205%	9,16297750%	1,25423576%	14,05478454%
31/05/2008	669.658.414,36	47,832738%	4.548.698,33	0,67313870%	7,78521766%	0,70476547%	8,13694775%	0,67486640%	7,80446379%	0,76154548%	8,76532983%	1,24029832%	13,90910299%
30/06/2008	664.562.236,01	47,468725%	3.686.758,57	0,55054316%	6,41009938%	0,70249565%	8,11174554%	0,62819142%	7,28322232%	0,71002747%	8,19534847%	1,22472546%	13,74605935%
31/07/2008	667.979.155,58	46,998505%	5.158.419,02	0,77621308%	8,92701388%	0,66511108%	7,69574407%	0,66658406%	7,71216750%	0,69694577%	8,05009734%	1,21364965%	13,62992654%
31/08/2008	653.970.997,89	46,712208%	2.629.919,34	0,39969645%	4,69230988%	0,57448557%	6,68012240%	0,63775190%	7,39020826%	0,66692944%	7,71601798%	1,19661096%	13,45099130%
30/09/2008	649.852.665,42	46,418041%	2.764.822,82	0,42277453%	4,95697384%	0,53215584%	6,20224083%	0,61560233%	7,14217228%	0,64620689%	7,48472885%	1,18059079%	13,28244237%
31/10/2008	645.742.339,74	46,124447%	2.770.532,37	0,42633239%	4,99771602%	0,41537716%	4,87221275%	0,53894779%	6,27906935%	0,60935094%	7,07205766%	1,16521454%	13,12038517%
30/11/2008	641.619.815,81	45,829981%	2.771.078,08	0,42913062%	5,02974825%	0,42518969%	4,98463233%	0,49850029%	5,82068685%	0,58338688%	6,78032934%	1,15043412%	12,96434616%
31/12/2008	636.366.553,42	45,454748%	3.607.263,23	0,56221194%	6,54178952%	0,47149900%	5,51354428%	0,50032719%	5,84143494%	0,56095323%	6,52759231%	1,13823302%	12,83534384%
31/01/2009	632.545.973,67	45,181849%	2.512.949,59	0,39489027%	4,63710669%	0,46109280%	5,39492775%	0,43678609%	5,11733224%	0,54884708%	6,39094382%	1,12390445%	12,68362402%
28/02/2009	628.064.369,67	44,861735%	3.065.364,96	0,48460746%	5,66276886%	0,47950327%	5,60468936%	0,45084066%	5,27793384%	0,54137174%	6,30647438%	1,11139441%	12,55096202%
31/03/2009	621.977.913,52	44,426988%	4.851.632,68	0,77247380%	8,88581990%	0,54934029%	6,39651451%	0,50855695%	5,93484821%	0,55874748%	6,50270840%	1,10348695%	12,46701246%
30/04/2009	613.936.587,88	43,852608%	6.754.872,41	1,08603091%	12,28142902%	0,77922097%	8,96013795%	0,61762562%	7,16485485%	0,57424573%	6,67742102%	1,10029856%	12,43314211%
31/05/2009	606.807.101,09	43,343359%	5.823.358,72	0,94852772%	10,80690747%	0,93374892%	10,64708160%	0,70362225%	8,12425517%	0,59656073%	6,92845349%	1,09523033%	12,37927729%
30/06/2009	601.452.873,65	42,960914%	4.077.516,48	0,67196255%	7,77211365%	0,90071112%	10,28884318%	0,72230207%	8,33144669%	0,60652829%	7,04038345%	1,08648654%	12,28627760%
31/07/2009	594.876.262,91	42,491156%	5.349.960,71	0,88950622%	10,16704655%	0,83498799%	9,57227069%	0,80442480%	9,23725945%	0,61540262%	7,13993308%	1,08092211%	12,22704670%
31/08/2009	591.352.472,09	42,239457%	2.175.148,68	0,36564725%	4,30059305%	0,64146536%	7,43173284%	0,78569452%	9,03138999%	0,61310367%	7,11415351%	1,06859200%	12,09566753%
30/09/2009	587.095.664,42	41,935399%	3.038.800,08	0,51387290%	5,99514271%	0,58892773%	6,84265583%	0,74305149%	8,56109156%	0,62088626%	7,20139818%	1,05854717%	11,98850512%
31/10/2009	582.817.641,80	41,629826%	2.918.615,83	0,49712781%	5,80509683%	0,45779318%	5,35728801%	0,64510922%	7,47246266%	0,62702566%	7,27016932%	1,04857991%	11,88205185%
30/11/2009	577.168.804,10	41,226338%	4.251.424,91	0,72946057%	8,41073336%	0,57879512%	6,72864967%	0,60825203%	7,05972752%	0,65183534%	7,54760172%	1,04179011%	11,80946729%
31/12/2009	570.645.269,15	40,760371%	5.202.251,73	0,90133973%	10,29567164%	0,70745055%	8,16675263%	0,64591857%	7,48150712%	0,67990289%	7,86054775%	1,03727553%	11,76117499%
31/01/2010	566.471.100,06	40,462216%	2.446.977,49	0,42880886%	5,02606554%	0,68532507%	7,92089161%	0,56931299%	6,62184653%	0,68323145%	7,89759587%	1,02717746%	11,65306861%
28/02/2010	562.254.890,16	40,161058%	2.785.347,72	0,49170165%	5,74343784%	0,60629854%	7,03780485%	0,59046149%	6,85990168%	0,68428915%	7,90936564%	1,01809291%	11,55570883%

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
31/03/2010	556.475.720,10	39,748260%	4.163.686,97	0,74053371%	8,53325407%	0,55189333%	6,42534565%	0,62773508%	7,27811288%	0,68130521%	7,87615776%	1,01212861%	11,49173560%
30/04/2010	552.293.032,29	39,449497%	2.555.916,72	0,45930427%	5,37452714%	0,56246556%	6,54464987%	0,62171333%	7,21066547%	0,62927733%	7,29537984%	1,00310096%	11,39482397%
31/05/2010	547.850.738,20	39,132190%	2.690.848,38	0,48721389%	5,69241434%	0,56104131%	6,52858582%	0,58144343%	6,75845923%	0,59090306%	6,86486622%	0,99461567%	11,30364593%
30/06/2010	542.938.571,33	38,781321%	3.194.709,10	0,58313494%	6,77749447%	0,50822954%	5,93113357%	0,52789207%	6,15398085%	0,58328644%	6,77919919%	0,98739179%	11,22595457%
31/07/2010	538.689.966,21	38,477850%	2.312.287,97	0,42588390%	4,99258116%	0,49724475%	5,80642519%	0,52776484%	6,15254041%	0,54464825%	6,34350670%	0,97864400%	11,13179031%
31/08/2010	536.092.710,82	38,292331%	817.621,95	0,15177969%	1,80622845%	0,38630439%	4,53841747%	0,47196134%	5,51881121%	0,52769447%	6,15174377%	0,96721702%	11,00864836%
30/09/2010	533.180.860,39	38,084342%	1.171.526,45	0,21853057%	2,59107659%	0,26478416%	3,13154289%	0,38534850%	4,52742435%	0,50357369%	5,87829502%	0,95677676%	10,89600298%
31/10/2010	530.074.171,71	37,862436%	1.332.961,09	0,25000168%	2,95911140%	0,20599122%	2,44408071%	0,35070061%	4,12817483%	0,48343021%	5,64937609%	0,94692014%	10,78953492%
30/11/2010	526.463.642,51	37,604541%	1.814.023,13	0,34222062%	4,03022659%	0,26924191%	3,18348556%	0,32643681%	3,84767112%	0,45122869%	5,28236427%	0,93823180%	10,69558960%
31/12/2010	521.401.531,12	37,242962%	3.286.267,30	0,62421543%	7,23866603%	0,40382173%	4,73966887%	0,33227225%	3,91520081%	0,42714279%	5,00699398%	0,93253604%	10,63395321%
31/01/2011	518.789.653,28	37,056399%	867.465,50	0,16637187%	1,97829489%	0,37669525%	4,42785556%	0,28950884%	3,41931826%	0,40603384%	4,76505549%	0,92251011%	10,52536337%
28/02/2011	516.459.653,79	36,889970%	583.152,55	0,11240636%	1,34056823%	0,30082252%	3,55073894%	0,28352667%	3,34976259%	0,37506753%	4,40911543%	0,91221116%	10,41369051%
31/03/2011	513.645.073,07	36,688929%	968.657,99	0,18755734%	2,22761531%	0,15490477%	1,84310168%	0,27865461%	3,29308042%	0,32929488%	3,88075119%	0,90286439%	10,31223172%
30/04/2011	510.787.927,02	36,484847%	1.018.465,80	0,19828201%	2,35360652%	0,16541918%	1,96706945%	0,27027364%	3,19550382%	0,30780493%	3,63176539%	0,89383471%	10,21411500%
31/05/2011	507.909.317,10	36,279232%	1.078.738,40	0,21119105%	2,50506178%	0,19826969%	2,35346185%	0,24855702%	2,94224498%	0,28500478%	3,36695307%	0,88512988%	10,11943482%
30/06/2011	505.290.984,45	36,092208%	890.476,24	0,17532190%	2,08369391%	0,19426462%	2,30642847%	0,17358561%	2,06325489%	0,25119272%	2,97301485%	0,87630112%	10,02331335%
31/07/2011	502.831.542,13	35,916534%	731.929,27	0,14485302%	1,72445455%	0,17658466%	2,09855634%	0,17007142%	2,02187487%	0,22809759%	2,70309205%	0,86740321%	9,92634354%
31/08/2011	500.640.207,20	35,760010%	482.465,35	0,09594970%	1,14533959%	0,13833081%	1,64739841%	0,16756508%	1,99235260%	0,22387527%	2,65366956%	0,85828080%	9,82682781%
30/09/2011	498.027.739,78	35,573405%	930.755,61	0,18591308%	2,20828567%	0,14171327%	1,68736705%	0,16724693%	1,98860453%	0,22125645%	2,62300455%	0,85013108%	9,73783784%

(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: 17/10/2011

A. FONDOS DISPONIBLES

Fondos Disponibles por Ingresos - Principal	7.256.668,04 €
Fondos Disponibles por Ingresos - Intereses	3.422.099,55 €
Fondos Disponibles por Ingresos - Demora	6.499,16 €
Fondos Disponibles por Rendimientos de Cuentas	96.680,86 €
Fondos Disponibles F.Reserva	25.386.203,83 €
Fondos Disponibles por Cobro Costas	4.115,49 €
Fondos Disponibles Otros	1.350,00 €
Total:	36.173.616,93 €

B. APLICACIÓN DE FONDOS

Impuestos	1.350,00 €
Gastos Terceros	14.263,06 €
Pago Costas	10.282,37 €
Comision Sociedad Gestora	84.495,11 €
Comision Agencia Pagos	3.750,00 €
Pago Cantidad Neta Swap	491.422,26 €
Comisión e Ints. Línea Liquidez	3.119,82 €
Pago Intereses Bonos Serie A2	1.977.487,43 €
Pago Intereses Bonos Serie B	81.570,30 €
Pago Intereses Bonos Serie C	170.646,00 €
Pago Intereses Bonos Serie D	136.460,80 €
Fondo Disponible para Amortización	7.444.188,32 €
Dotación Fondo Reserva	25.386.203,83 €
Remuneración Fija Préstamo Subordinado	82.164,84 €
Amortizacion Ptmo. Subordinado (G.Inicio)	7.024,88 €
Remuneración Variable Ptmo. Subordinado	279.187,91 €

Origen y aplicación de fondos

Fecha de pago: 17/10/2011

Total:

36.173.616,93 €