

Bonos Titulización de Activos SERIE A

Número de Bonos:		11.721											
Código ISIN:		ES0345675005											
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			
09/02/2012	1,5450%	74,44 €	58,81 €	872.511,24 €	0,00	72.272,26 €	0,00 €	0,00%	847.103.159,46 €	0,00 €	847.103.159,46 €	847.103.159,46 €	0,00 €
16/01/2012	1,8720%	348,67 €	275,45 €	4.086.761,07 €	0,00	1.410,66 €	72.272,26 €	72,27%	16.534.345,86 €	847.103.159,46 €	16.534.345,86 €	16.534.345,86 €	0,00 €
17/10/2011	1,9050%	372,11 €	301,41 €	4.361.501,31 €	0,00	1.125,52 €	73.682,92 €	73,68%	13.192.219,92 €	863.637.505,32 €	13.192.219,92 €	13.192.219,92 €	0,00 €
15/07/2011	1,6270%	313,50 €	253,94 €	3.674.533,50 €	0,00	1.419,57 €	74.808,44 €	74,81%	16.638.779,97 €	876.829.725,24 €	16.638.779,97 €	16.638.779,97 €	0,00 €
15/04/2011	1,2980%	245,73 €	199,04 €	2.880.201,33 €	0,00	1.218,90 €	76.228,01 €	76,23%	14.286.726,90 €	893.468.505,21 €	14.286.726,90 €	14.286.726,90 €	0,00 €
17/01/2011	1,2850%	265,68 €	215,20 €	3.114.035,28 €	0,00	1.735,46 €	77.446,91 €	77,45%	20.341.326,66 €	907.755.232,11 €	20.341.326,66 €	20.341.326,66 €	0,00 €
15/10/2010	1,1350%	233,71 €	189,31 €	2.739.314,91 €	0,00	1.392,13 €	79.182,37 €	79,18%	16.317.155,73 €	928.096.558,77 €	16.317.155,73 €	16.317.155,73 €	0,00 €
15/07/2010	0,9440%	196,92 €	159,51 €	2.308.099,32 €	0,00	1.947,67 €	80.574,50 €	80,57%	22.828.640,07 €	944.413.714,50 €	22.828.640,07 €	22.828.640,07 €	0,00 €
15/04/2010	0,9840%	207,62 €	168,17 €	2.433.514,02 €	0,00	1.877,05 €	82.522,17 €	82,52%	22.000.903,05 €	967.242.354,57 €	22.000.903,05 €	22.000.903,05 €	0,00 €
15/01/2010	1,0420%	231,32 €	187,37 €	2.711.301,72 €	0,00	2.467,31 €	84.399,22 €	84,40%	28.919.340,51 €	989.243.257,62 €	28.919.340,51 €	28.919.340,51 €	0,00 €
15/10/2009	1,2960%	294,68 €	241,64 €	3.453.944,28 €	0,00	2.105,75 €	86.866,53 €	86,87%	24.681.495,75 €	1.018.162.598,13 €	24.681.495,75 €	24.681.495,75 €	0,00 €
15/07/2009	1,7450%	409,54 €	335,82 €	4.800.218,34 €	0,00	3.874,56 €	88.972,28 €	88,97%	45.413.717,76 €	1.042.844.093,88 €	45.413.717,76 €	45.413.717,76 €	0,00 €
15/04/2009	2,9120%	696,23 €	570,91 €	8.160.511,83 €	0,00	2.788,99 €	92.846,84 €	92,85%	32.689.751,79 €	1.088.257.811,64 €	32.689.751,79 €	32.689.751,79 €	0,00 €
15/01/2009	5,6180%	1.397,65 €	1.146,07 €	16.381.855,65 €	0,00	1.713,11 €	95.635,83 €	95,64%	20.079.362,31 €	1.120.947.563,43 €	20.079.362,31 €	20.079.362,31 €	0,00 €
15/10/2008	5,1860%	2.146,43 €	1.760,07 €	25.158.306,03 €	0,00	2.651,06 €	97.348,94 €	97,35%	31.073.074,26 €	1.141.026.925,74 €	31.073.074,26 €	31.073.074,26 €	0,00 €
19/05/2008							100.000,00 €			1.172.100.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos SERIE B

Número de Bonos: 48													
Código ISIN: ES0345675013													
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			
09/02/2012	1,8450%	123,00 €	97,17 €	5.904,00 €	0,00	100.000,00 €	0,00 €	0,00%	4.800.000,00 €	0,00 €	4.800.000,00 €	4.800.000,00 €	0,00 €
16/01/2012	2,1720%	549,03 €	433,73 €	26.353,44 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	4.800.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/10/2011	2,2050%	575,75 €	466,36 €	27.636,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	4.800.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/07/2011	1,9270%	487,10 €	394,55 €	23.380,80 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	4.800.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/04/2011	1,5980%	390,62 €	316,40 €	18.749,76 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	4.800.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/01/2011	1,5850%	413,86 €	335,23 €	19.865,28 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	4.800.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2010	1,4350%	366,72 €	297,04 €	17.602,56 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	4.800.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/07/2010	1,2440%	314,46 €	254,71 €	15.094,08 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	4.800.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/04/2010	1,2840%	321,00 €	260,01 €	15.408,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	4.800.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/01/2010	1,3420%	342,96 €	277,80 €	16.462,08 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	4.800.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2009	1,5960%	407,87 €	334,45 €	19.577,76 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	4.800.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/07/2009	2,0450%	516,93 €	423,88 €	24.812,64 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	4.800.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/04/2009	3,2120%	803,00 €	658,46 €	38.544,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	4.800.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/01/2009	5,9180%	1.512,38 €	1.240,15 €	72.594,24 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	4.800.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2008	5,4860%	2.270,59 €	1.861,88 €	108.988,32 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	4.800.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
19/05/2008							100.000,00 €			4.800.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos SERIE C

Número de Bonos:		231											
Código ISIN:		ES0345675021											
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			
09/02/2012	2,4450%	163,00 €	128,77 €	37.653,00 €	0,00	100.000,00 €	0,00 €	0,00%	23.100.000,00 €	0,00 €	23.100.000,00 €	23.100.000,00 €	0,00 €
16/01/2012	2,7720%	700,70 €	553,55 €	161.861,70 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	23.100.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/10/2011	2,8050%	732,42 €	593,26 €	169.189,02 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	23.100.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/07/2011	2,5270%	638,77 €	517,40 €	147.555,87 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	23.100.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/04/2011	2,1980%	537,29 €	435,20 €	124.113,99 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	23.100.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
17/01/2011	2,1850%	570,53 €	462,13 €	131.792,43 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	23.100.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2010	2,0350%	520,06 €	421,25 €	120.133,86 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	23.100.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/07/2010	1,8440%	466,12 €	377,56 €	107.673,72 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	23.100.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/04/2010	1,8840%	471,00 €	381,51 €	108.801,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	23.100.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/01/2010	1,9420%	496,29 €	401,99 €	114.642,99 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	23.100.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2009	2,1960%	561,20 €	460,18 €	129.637,20 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	23.100.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/07/2009	2,6450%	668,60 €	548,25 €	154.446,60 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	23.100.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/04/2009	3,8120%	953,00 €	781,46 €	220.143,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	23.100.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/01/2009	6,5180%	1.665,71 €	1.365,88 €	384.779,01 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	23.100.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
15/10/2008	6,0860%	2.518,93 €	2.065,52 €	581.872,83 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	23.100.000,00 €	0,00 €	0,00 €	0,00 €
19/05/2008							100.000,00 €			23.100.000,00 €			

Índice (1)			Número PH	%	Principal pendiente	%	Tipo nominal	Margen s/ Referencia	Principal/ Tasación	Vida residual	
										Meses	Fecha
Índice	CECA	Tipo Activo CECA	42	0,450595%	832.320,43	0,095885%	5,390060%	0,277292	32,466019	125,945930	30/07/2022
Índice	ER1A	Euribor 1 año	6.492	69,649179%	711.584.970,47	81,976358%	2,631629%	0,660458	47,173798	265,194923	08/03/2034
Índice	IRMH	Mercado Hipotecario	1	0,010728%	145,51	0,000017%	3,000000%	0,000000	0,258249	0,952772	29/02/2012
Índice	IRPC	Préstamos Hipotecarios Cajas	607	6,512177%	29.089.172,43	3,351145%	3,633608%	0,196493	44,308030	251,383442	11/01/2033
Índice	IRPE	Préstamos Hipotecarios Entidades	97	1,040661%	452.692,67	0,052151%	3,607803%	0,373800	9,239571	29,967794	31/07/2014
Índice	MB1A	Mibor 1 Año	45	0,482781%	936.354,64	0,107870%	2,827334%	0,914865	25,433948	98,822942	26/04/2020
Índice	TAE1	Préstamos Hipotecarios Cajas TAE	2.036	21,843150%	125.129.160,58	14,415191%	3,483492%	0,094469	46,105986	227,944336	29/01/2031
Índice	TAE3	Tipo Activo C.E.C.A TAE	1	0,010728%	11.997,90	0,001382%	5,125000%	0,250000	18,864623	40,936345	30/06/2015
Total CatalunyaCaixa			9.321	100%	868.036.814,63	100%	2,791404%	0,563073	46,866099	258,923534	29/08/2033
Total cartera			9.321	100%	868.036.814,63	100%					
<i>Media ponderada:</i>							2,791404	0,563073	46,866099	258,923534	29/08/2033
<i>Media simple:</i>							2,947733	0,544846	37,282362	209,805399	26/07/2029
<i>Mínimo:</i>							1,876000	-0,350000	0,128000	0,952772	29/02/2012
<i>Máximo:</i>							6,600000	4,500000	446,466972	432,952772	29/02/2048

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

Índice (1)			Número PH	%	Principal pendiente	%	Tipo nominal	Margen s/ Referencia	Principal/ Tasación	Vida residual		
										Meses	Fecha	
Índice	ER1A	Euribor 1 año	15	75,000000%	1.997.813,29	81,136326%	2,699342%	0,751249	55,935884	270,591968	19/08/2034	
Índice	IRPC	Préstamos Hipotecarios Cajas	2	10,000000%	177.094,41	7,192259%	3,627797%	0,159971	41,928467	294,269289	09/08/2036	
Índice	TAE1	Préstamos Hipotecarios Cajas TAE	3	15,000000%	287.384,34	11,671416%	3,339198%	0,050576	58,523048	259,271465	09/09/2033	
Total CatalunyaCaixa			20	100%	2.462.292,04	100%	2,840799%	0,626944	55,230393	270,973639	31/08/2034	
Total cartera			20	100%	2.462.292,04	100%						
<i>Media ponderada:</i>							2,840799	0,626944	55,230393	270,973639	31/08/2034	
<i>Media simple:</i>							123.114,60	2,933300	0,661500	46,268588	238,188090	07/12/2031
<i>Mínimo:</i>							662,45	2,000000	0,050000	0,984304	2,956879	30/04/2012
<i>Máximo:</i>							267.047,44	4,030000	1,250000	71,008617	423,950719	31/05/2047

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

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	183	49.452,60	24.455,04	73.907,64	50,81%	21.705.666,00	77,05%	21.755.118,60	76,97%	21.779.573,64	49.299.363,34	44,1286%	44,1782%
De 1 a 2 Meses	37	29.561,07	15.347,88	44.908,95	30,87%	4.493.295,60	15,95%	4.522.856,67	16,00%	4.538.204,55	10.213.111,59	44,2848%	44,4351%
De 2 a 3 Meses	12	15.582,80	11.064,52	26.647,32	18,32%	1.970.537,02	7,00%	1.986.119,82	7,03%	1.997.184,34	3.826.650,52	51,9023%	52,1914%
Total cedente:	232	94.596,47	50.867,44	145.463,91	100%	28.169.498,62	100%	28.264.095,09	100%	28.314.962,53	63.339.125,45	44,6234%	44,7037%
Total listado:	232	94.596,47	50.867,44	145.463,91	100%	28.169.498,62	100%	28.264.095,09	100%	28.314.962,53	63.339.125,45	44,6234%	44,7037%

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	271,00	0,00	271,00	0,26%	121.893,59	4,95%	122.164,59	4,79%	122.164,59	171.660,28	71,1665%	71,1665%
De 2 a 3 Meses	1	857,53	0,00	857,53	0,82%	124.701,58	5,06%	125.559,11	4,92%	125.559,11	396.342,00	31,6795%	31,6795%
De 3 a 6 Meses	6	12.284,32	5.263,15	17.547,47	16,88%	711.801,86	28,91%	724.086,18	28,37%	729.349,33	1.447.923,94	50,0086%	50,3721%
De 6 a 12 Meses	10	66.885,06	6.458,82	73.343,88	70,55%	1.238.367,60	50,29%	1.305.252,66	51,14%	1.311.711,48	2.619.744,94	49,8237%	50,0702%
De 12 Meses a 2 Años	2	9.909,86	2.029,70	11.939,56	11,48%	265.527,41	10,78%	275.437,27	10,79%	277.466,97	425.671,70	64,7065%	65,1833%
Total cedente:	20	90.207,77	13.751,67	103.959,44	100%	2.462.292,04	100%	2.552.499,81	100%	2.566.251,48	5.061.342,86	50,4313%	50,7030%
Total listado:	20	90.207,77	13.751,67	103.959,44	100%	2.462.292,04	100%	2.552.499,81	100%	2.566.251,48	5.061.342,86	50,4313%	50,7030%

<u>Antigüedad de la deuda</u>	<u>Cuotas</u>	<u>Principal</u>	<u>% Principal</u>	<u>Intereses</u>	<u>% Intereses</u>	<u>Comisiones</u>	<u>Demora</u>	<u>Total deuda</u>	<u>% no cobrada</u>
CatalunyaCaixa									
Hasta 1 Mes	238	73.975,72	78,20%	40.450,71	79,52%	0,00	0,00	114.426,43	78,66%
De 1 a 2 Meses	43	15.788,80	16,69%	8.408,14	16,53%	0,00	0,00	24.196,94	16,63%
De 2 a 3 Meses	12	4.831,95	5,11%	2.008,59	3,95%	0,00	0,00	6.840,54	4,70%
Total cedente:	293	94.596,47	100,00%	50.867,44	100,00%	0,00	0,00	145.463,91	100,00%
Total listado:	293	94.596,47	100,00%	50.867,44	100,00%	0,00	0,00	145.463,91	100,00%

<u>Antigüedad de la deuda</u>	<u>Cuotas</u>	<u>Principal</u>	<u>% Principal</u>	<u>Intereses</u>	<u>% Intereses</u>	<u>Comisiones</u>	<u>Demora</u>	<u>Total deuda</u>	<u>% no cobrada</u>
CatalunyaCaixa									
Hasta 1 Mes	39	18.066,36	20,03%	1.089,64	7,92%	0,00	0,00	19.156,00	18,43%
De 1 a 2 Meses	19	8.900,31	9,87%	639,31	4,65%	0,00	0,00	9.539,62	9,18%
De 2 a 3 Meses	18	8.653,55	9,59%	1.186,55	8,63%	0,00	0,00	9.840,10	9,47%
De 3 a 6 Meses	49	22.787,82	25,26%	3.178,53	23,11%	0,00	0,00	25.966,35	24,98%
De 6 a 12 Meses	49	30.090,09	33,36%	6.114,25	44,46%	0,00	0,00	36.204,34	34,83%
De 12 Meses a 2 Años	5	1.709,64	1,90%	1.543,39	11,22%	0,00	0,00	3.253,03	3,13%
Total cedente:	179	90.207,77	100,00%	13.751,67	100,00%	0,00	0,00	103.959,44	100,00%
Total listado:	179	90.207,77	100,00%	13.751,67	100,00%	0,00	0,00	103.959,44	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
14/05/2008	1.200.001.439,29	100,000000%	0,00										
31/05/2008	1.194.763.340,13	99,563492%	2.366.079,35	0,19717304%	2,34058545%							0,33933397%	3,99686334%
30/06/2008	1.188.944.082,89	99,078555%	2.885.491,25	0,24151153%	2,85995026%							0,27709118%	3,27488483%
31/07/2008	1.180.000.151,86	98,333228%	6.235.904,39	0,52449097%	6,11546883%							0,37204241%	4,37427814%
31/08/2008	1.175.046.605,41	97,920433%	2.109.735,10	0,17879109%	2,12452055%	0,31433025%	3,70743110%					0,31775182%	3,74708488%
30/09/2008	1.170.352.083,98	97,529223%	1.995.961,51	0,16986233%	2,01941222%	0,29078270%	3,43412372%					0,28513020%	3,36841167%
31/10/2008	1.163.405.338,14	96,950329%	3.804.073,12	0,32503664%	3,83146147%	0,22394092%	2,65443812%					0,29159081%	3,44351497%
30/11/2008	1.158.140.338,51	96,511579%	2.337.568,05	0,20092465%	2,38462872%	0,23137977%	2,74149423%	0,27203261%	3,21599032%			0,27737397%	3,27817625%
31/12/2008	1.149.229.091,09	95,768976%	6.249.883,79	0,53964823%	6,28698920%	0,35418166%	4,16835616%	0,32124279%	3,78752755%			0,31079270%	3,66641749%
31/01/2009	1.142.987.142,55	95,248814%	3.590.455,59	0,31242296%	3,68532041%	0,35014013%	4,12170379%	0,28575790%	3,37571081%			0,31027478%	3,66041143%
28/02/2009	1.132.976.284,27	94,414577%	7.353.611,24	0,64336780%	7,45299975%	0,49734179%	5,80752752%	0,36256913%	4,26510837%			0,34362784%	4,04648698%
31/03/2009	1.116.725.621,09	93,060357%	13.591.913,68	1,19966445%	13,48308305%	0,71679052%	8,27035868%	0,53292456%	6,21093923%			0,42208524%	4,94907874%
30/04/2009	1.100.794.356,12	91,732753%	13.240.749,50	1,18567616%	13,33597836%	1,00709461%	11,43770772%	0,67550772%	7,81160695%			0,48549108%	5,67282015%
31/05/2009	1.086.508.700,17	90,542283%	11.546.543,50	1,04892830%	11,88577475%	1,14215136%	12,87679159%	0,81622234%	9,36670997%	0,53836950%	6,27253015%	0,52792318%	6,15433309%
30/06/2009	1.071.874.066,52	89,322732%	11.588.852,91	1,06661391%	12,07457387%	1,09780544%	12,40664923%	0,90354211%	10,31959188%	0,60607139%	7,03525537%	0,56514539%	6,57486869%
31/07/2009	1.060.704.215,24	88,391912%	8.488.416,74	0,79192295%	9,09989574%	0,96692515%	11,00550098%	0,98348773%	11,18394116%	0,62785634%	7,27947065%	0,57879375%	6,72863425%
31/08/2009	1.054.521.765,79	87,876708%	3.239.454,57	0,30540602%	3,60393462%	0,72051995%	8,31169842%	0,92888438%	10,59441645%	0,63919083%	7,40630064%	0,56052653%	6,52277901%
30/09/2009	1.047.142.982,60	87,261811%	4.385.424,53	0,41586856%	4,87784558%	0,50362632%	5,87889248%	0,79918129%	9,17966965%	0,66012898%	7,64017499%	0,55078612%	6,41284314%
31/10/2009	1.036.743.444,75	86,395183%	7.396.182,01	0,70632016%	8,15420618%	0,47429279%	5,54536643%	0,71903246%	8,29521209%	0,69194830%	7,99455298%	0,55788162%	6,49293871%
30/11/2009	1.026.741.334,32	85,561675%	6.875.127,73	0,66314649%	7,67383517%	0,59325010%	6,89124978%	0,65447371%	7,57706030%	0,73054094%	8,42269391%	0,56187959%	6,53804110%
31/12/2009	1.017.759.100,30	84,813157%	5.746.184,60	0,55965260%	6,51292019%	0,64131388%	7,43003936%	0,56985795%	6,62798774%	0,73248161%	8,44417509%	0,56033850%	6,52065792%
31/01/2010	1.011.160.288,93	84,263256%	3.282.328,83	0,32250548%	3,80215189%	0,51397036%	5,99624779%	0,49192486%	5,74597496%	0,73421260%	8,46333141%	0,54796340%	6,38096212%
28/02/2010	1.004.518.039,68	83,709736%	3.254.812,40	0,32188887%	3,79501064%	0,40038119%	4,70017230%	0,49509383%	5,78198851%	0,70831442%	8,17633981%	0,53665837%	6,25317855%
31/03/2010	996.182.499,93	83,015109%	4.773.578,24	0,47521080%	5,55582080%	0,37182604%	4,37178600%	0,50496190%	5,89405243%	0,64808050%	7,50566245%	0,53267983%	6,20817010%
30/04/2010	989.737.552,21	82,478030%	2.992.611,76	0,30040798%	3,54592655%	0,36464009%	4,28898380%	0,43759952%	5,12663413%	0,57476874%	6,68331168%	0,52203437%	6,08764273%
31/05/2010	982.585.732,72	81,882046%	3.670.660,47	0,37087210%	4,36079775%	0,38096318%	4,47697641%	0,38879938%	4,56710549%	0,51838619%	6,04630545%	0,51488178%	6,00658162%
30/06/2010	974.687.297,01	81,223844%	4.410.593,65	0,44887622%	5,25550109%	0,37192498%	4,37292558%	0,36997167%	4,35042480%	0,46672685%	5,45916515%	0,51106792%	5,96333252%
31/07/2010	968.229.434,37	80,685689%	2.973.327,75	0,30505453%	3,59985617%	0,37370163%	4,39338721%	0,36722037%	4,31872338%	0,42624429%	4,99670745%	0,50247753%	5,86585090%
31/08/2010	963.447.656,59	80,287208%	1.287.496,64	0,13297433%	1,58407334%	0,29503965%	3,48358516%	0,33644772%	3,96349409%	0,41264579%	4,84089853%	0,48873176%	5,70967462%
30/09/2010	957.816.699,78	79,817963%	2.135.418,42	0,22164343%	2,62753647%	0,21922537%	2,59921565%	0,29444320%	3,47665645%	0,39689526%	4,66013938%	0,47877254%	5,59637179%
31/10/2010	952.559.946,33	79,379900%	1.756.347,42	0,18336989%	2,17838158%	0,17862588%	2,12257668%	0,27525673%	3,25353103%	0,35370802%	4,16288988%	0,46827836%	5,47684799%
30/11/2010	945.975.299,15	78,831180%	3.015.270,09	0,31654387%	3,73308724%	0,23954277%	2,83694275%	0,26600520%	3,14577319%	0,32469538%	3,82751029%	0,46241114%	5,40996254%
31/12/2010	937.814.651,04	78,151127%	4.644.059,66	0,49092822%	5,73464614%	0,32875810%	3,87453911%	0,27222185%	3,21819421%	0,31826237%	3,75300062%	0,46188945%	5,40401334%
31/01/2011	932.835.378,01	77,736188%	1.524.389,85	0,16254703%	1,93322027%	0,32240814%	3,80102462%	0,24878009%	2,94484951%	0,30538054%	3,60363898%	0,45224028%	5,29391364%
28/02/2011	928.590.440,08	77,382444%	802.084,67	0,08598352%	1,02693668%	0,24622650%	2,91503050%	0,24152151%	2,86006681%	0,28641040%	3,38329799%	0,44110052%	5,16665981%

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
31/03/2011	923.766.000,05	76,980408%	1.228.158,48	0,13226051%	1,57563163%	0,12650451%	1,50753633%	0,22697635%	2,68997006%	0,25827981%	3,05570705%	0,43179274%	5,06021323%
30/04/2011	918.806.156,67	76,567088%	1.541.416,28	0,16686220%	1,98407186%	0,12779059%	1,52275480%	0,22443268%	2,66019536%	0,24742107%	2,92898085%	0,42386094%	4,96941642%
31/05/2011	913.223.668,49	76,101881%	2.186.829,42	0,23800770%	2,81900000%	0,17823605%	2,11798974%	0,21124727%	2,50572091%	0,23632146%	2,79928676%	0,41807443%	4,90312685%
30/06/2011	907.850.617,98	75,654127%	2.009.886,79	0,22008702%	2,60930838%	0,20748598%	2,46161406%	0,16583531%	1,97197275%	0,21721514%	2,57566561%	0,41215113%	4,83522633%
31/07/2011	903.210.538,94	75,267455%	1.301.637,42	0,14337573%	1,70700600%	0,19987379%	2,37229366%	0,16271142%	1,93515794%	0,20395491%	2,42019033%	0,40476215%	4,75046212%
31/08/2011	899.297.234,44	74,941346%	599.260,87	0,06634786%	0,79327540%	0,14295077%	1,70198630%	0,15978837%	1,90069854%	0,19889196%	2,36076752%	0,39602608%	4,65015512%
30/09/2011	894.601.875,86	74,550067%	1.398.600,73	0,15552152%	1,85037733%	0,12129398%	1,44585680%	0,16372643%	1,94712121%	0,19352322%	2,29771956%	0,38963571%	4,57671999%
31/10/2011	889.383.858,05	74,115233%	1.941.965,84	0,21707599%	2,57403526%	0,14561278%	1,73342702%	0,17194111%	2,04389260%	0,19626189%	2,32988592%	0,38482989%	4,52145961%
30/11/2011	884.514.075,19	73,709418%	1.456.336,69	0,16374670%	1,94736003%	0,17811900%	2,11661237%	0,15955359%	1,89793021%	0,18361866%	2,18130714%	0,37914473%	4,45605020%
31/12/2011	878.278.266,08	73,189768%	3.000.928,85	0,33927429%	3,99617347%	0,23900951%	2,83070997%	0,17885076%	2,12522271%	0,17034356%	2,02507989%	0,37719141%	4,43356711%
31/01/2012	873.740.850,65	72,811650%	1.319.483,16	0,15023521%	1,78800021%	0,21697797%	2,57288685%	0,18010600%	2,13999087%	0,16939630%	2,01392332%	0,37164531%	4,36970423%

(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: 09/02/2012

A. FONDOS DISPONIBLES

Fondos Disponibles por Ingresos - Principal	4.775.173,63 €
Fondos Disponibles por Ingresos - Intereses	1.997.410,32 €
Fondos Disponibles por Ingresos - Demora	5.964,66 €
Fondos Disponibles por Rendimientos de Cuentas	11.773,44 €
Fondos Disponibles F.Reserva	12.600.000,00 €
Fondos Disponibles por Cobro de Costas	785,20 €
Precio venta totalidad Derechos de Crédito	870.953.619,25 €
Total:	890.344.726,50 €

B. APLICACIÓN DE FONDOS

Provisión Gastos Liquidación	170.000,00 €
Facturas pendientes de recibir	26.309,66 €
Gastos Terceros	177,00 €
Pago Costas	6.514,69 €
Comision Sociedad Gestora	14.583,39 €
Comision Agencia Pagos	3.750,00 €
Pago Cantidad Neta Swap	446.050,74 €
Pago Intereses Bonos Serie A	872.511,24 €
Pago Intereses Bonos Serie B	5.904,00 €
Pago Intereses Bonos Serie C	37.653,00 €
Fondo Disponible para Amortización	875.003.159,46 €
Remuneración Fija Préstamo Subordinado	10.226,76 €
Amortización Ptmo. Subordinado (G. Inicio)	12.492.523,37 €
Remuneración Variable Ptmo. Subordinado	1.255.363,19 €
Total:	890.344.726,50 €