



Importes expresados en euros

| | | | |
|--|--|--------------------------------------|--|
| Fecha Constitución | 19/06/2009 | Directores Aseguramiento | Caixa Catalunya, Caixa Manresa, Caixa Penedès i Caixa Terrassa |
| Fecha Emisión Bonos | 19/06/2009 | Originador | |
| Fecha Desembolso | 25/06/2009 | Garante del Swap | |
| Sociedad Gestora | Gestión de Activos Titulizados | Agente de Pagos | Caixa d'Estalvis de Catalunya |
| Administrador | Caixa Catalunya, Caixa Manresa, Caixa Penedès i Caixa Terrassa | Mercado Negociación | |
| Cta. Tesorería a Tipo Garantizado | Banco Sabadell | Reg. Contable Valores | S.C.L.V. Espaclear |
| Permutas Intereses | Confederación Española de Cajas de Ahorros | Depositarario Participaciones | Caixa Manresa |
| Prestamo Subordinado | Caixa Catalunya, Caixa Manresa, Caixa Penedès i Caixa Terrassa | Auditores | Deloitte & Touche |
| Directores | Caixa Catalunya, Caixa Manresa, Caixa Penedès i Caixa Terrassa | | |

VALORES EMITIDOS: BONOS DE TITULIZACIÓN HIPOTECARIA (ESTRUCTURA PREFERENTE/SUBORDINADA)

| Serie Código ISIN Prelación/Tipo Amortización | Nominal Circulación (Unitario/Total) | | | Clase Intereses Frecuencia | Tipo Interés Actual Periodo Devengado: 91 días Base: A/ 360 | Amortización | | Calificación Moody's / S & P / Fitch Ibca | |
|---|--------------------------------------|------------------------|------------------------|-----------------------------------|--|----------------------------|------------|--|---------|
| | Factor Actual | Actual | Inicial | | | Final Frecuencia | Próxima | Actual | Inicial |
| SERIE AG ES0341068007 | 97,96% | 97.961,47€ 3.316 | 100.000,00€ 3.316 | Variable EURIB.3M+0,50% | 1,266% Fecha: 21-12-2009 | 20-06-2032 21-12-2009 | Aaa Aaa | Aaa Aaa | |
| Preferente / Pass-Through | | 324.840.234,52€ | 331.600.000,00€ | 21-3/6/9/12 | Intereses: 313,49 € | 21-3/6/9/12 | AAA | AAA | |
| Serie B (CA) ES0341068015 | 100,00% | 100.000,00€ 98 | 100.000,00€ 98 | Variable EURIB.3M+0,80% | 1,566% Fecha: 21-12-2009 | 20-06-2036 A determinar | A2 A | A2 A | |
| Subordinada / Pass-Through | | 9.800.000,00€ | 9.800.000,00€ | 21-3/6/9/12 | Intereses: 395,85 € | 21-3/6/9/12 | A | A | |
| Serie B (CM) ES0341068023 | 100,00% | 100.000,00€ 33 | 100.000,00€ 33 | Variable EURIB.3M+0,80% | 1,566% Fecha: 21-12-2009 | 20-06-2036 A determinar | A2 A | A2 A | |
| Subordinada / Pass-Through | | 3.300.000,00€ | 3.300.000,00€ | 21-3/6/9/12 | Intereses: 395,85 € | 21-3/6/9/12 | A | A | |
| Serie B (CP) ES0341068031 | 100,00% | 100.000,00€ 27 | 100.000,00€ 27 | Variable EURIB.3M+0,80% | 1,566% Fecha: 21-12-2009 | 20-06-2036 A determinar | A2 A | A2 A | |
| Subordinada / Pass-Through | | 2.700.000,00€ | 2.700.000,00€ | 21-3/6/9/12 | Intereses: 395,85 € | 21-3/6/9/12 | A | A | |
| Serie B (CT) ES0341068049 | 100,00% | 100.000,00€ 20 | 100.000,00€ 20 | Variable EURIB.3M+0,80% | 1,566% Fecha: 21-12-2009 | 20-06-2036 A determinar | A2 A | A2 A | |
| Subordinada / Pass-Through | | 2.000.000,00€ | 2.000.000,00€ | 21-3/6/9/12 | Intereses: 395,85 € | 21-3/6/9/12 | A | A | |
| Serie C (CA) ES0341068056 | 100,00% | 100.000,00€ 32 | 100.000,00€ 32 | Variable EURIB.3M+2,00% | 2,766% Fecha: 21-12-2009 | 20-06-2036 A determinar | Ba2 BBB | Ba2 BBB | |
| Subordinada / Pass-Through | | 3.200.000,00€ | 3.200.000,00€ | 21-3/6/9/12 | Intereses: 699,18 € | 21-3/6/9/12 | BBB | BBB | |
| Serie C (CM) ES0341068064 | 100,00% | 100.000,00€ 23 | 100.000,00€ 23 | Variable EURIB.3M+2,00% | 2,766% Fecha: 21-12-2009 | 20-06-2036 A determinar | Ba2 BBB | Ba2 BBB | |
| Subordinada / Pass-Through | | 2.300.000,00€ | 2.300.000,00€ | 21-3/6/9/12 | Intereses: 699,18 € | 21-3/6/9/12 | BBB | BBB | |
| Serie C (CP) ES0341068072 | 100,00% | 100.000,00€ 15 | 100.000,00€ 15 | Variable EURIB.3M+2,00% | 2,766% Fecha: 21-12-2009 | 20-06-2036 A determinar | Ba2 BBB | Ba2 BBB | |
| Subordinada / Pass-Through | | 1.500.000,00€ | 1.500.000,00€ | 21-3/6/9/12 | Intereses: 699,18 € | 21-3/6/9/12 | BBB | BBB | |
| Serie C (CT) ES0341068080 | 100,00% | 100.000,00€ 15 | 100.000,00€ 15 | Variable EURIB.3M+2,00% | 2,766% Fecha: 21-12-2009 | 20-06-2036 A determinar | Ba2 BBB | Ba2 BBB | |
| Subordinada / Pass-Through | | 1.500.000,00€ | 1.500.000,00€ | 21-3/6/9/12 | Intereses: 699,18 € | 21-3/6/9/12 | BBB | BBB | |
| Serie D (CA) ES0341068098 | 100,00% | 100.000,00€ 61 | 100.000,00€ 61 | Variable EURIB.3M+5,00% | 5,766% Fecha: 21-12-2009 | 20-06-2036 A determinar | C C | C C | |
| Equity / Por reducción Fondo Reserva | | 6.100.000,00€ | 6.100.000,00€ | 21-3/6/9/12 | Intereses: 1457,52 € | 21-3/6/9/12 | C | C | |
| Serie D (CM) ES0341068106 | 100,00% | 100.000,00€ 25 | 100.000,00€ 25 | Variable EURIB.3M+5,00% | 5,766% Fecha: 21-12-2009 | 20-06-2036 A determinar | C C | C C | |
| Equity / Por reducción Fondo Reserva | | 2.500.000,00€ | 2.500.000,00€ | 21-3/6/9/12 | Intereses: 1457,52 € | 21-3/6/9/12 | C | C | |
| Serie D (CP) ES0341068114 | 100,00% | 100.000,00€ 16 | 100.000,00€ 16 | Variable EURIB.3M+5,00% | 5,766% Fecha: 21-12-2009 | 20-06-2036 A determinar | C C | C C | |
| Equity / Por reducción Fondo Reserva | | 1.600.000,00€ | 1.600.000,00€ | 21-3/6/9/12 | Intereses: 1457,52 € | 21-3/6/9/12 | C | C | |
| Serie D (CT) ES0341068122 | 100,00% | 100.000,00€ 14 | 100.000,00€ 14 | Variable EURIB.3M+5,00% | 5,766% Fecha: 21-12-2009 | 20-06-2036 A determinar | C C | C C | |
| Equity / Por reducción Fondo Reserva | | 1.400.000,00€ | 1.400.000,00€ | 21-3/6/9/12 | Intereses: 1457,52 € | 21-3/6/9/12 | C | C | |
| Totales | | 362.740.234,52€ | 369.500.000,00€ | | | | | | |

VIDA MEDIA EN AÑOS Y AMORTIZACIÓN FINAL ESTIMADA SEGÚN TASAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA



| | Opción ⁽¹⁾ | % mensual constante | - | 0.3396% | 0.5143% | 0.6924% |
|---------------------------|-------------------------------------|---------------------|---|------------|------------|------------|
| | | % anual equivalente | - | 4.0000% | 6.0000% | 8.0000% |
| Bonos SERIE AG | Con ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | 5.75 | 5.24 | 4.82 |
| | | Amortización Final | - | 20/09/2022 | 20/12/2021 | 21/06/2021 |
| ISIN: ES0341068007 | Sin ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | - | - | - |
| | | Amortización Final | - | - | - | - |
| Bonos Serie B (CA) | Con ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | 13.24 | 12.49 | 11.99 |
| | | Amortización Final | - | 20/09/2022 | 20/12/2021 | 21/06/2021 |
| ISIN: ES0341068015 | Sin ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | - | - | - |
| | | Amortización Final | - | - | - | - |
| Bonos Serie B (CM) | Con ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | 13.24 | 12.49 | 11.99 |
| | | Amortización Final | - | 20/09/2022 | 20/12/2021 | 21/06/2021 |
| ISIN: ES0341068023 | Sin ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | - | - | - |
| | | Amortización Final | - | - | - | - |
| Bonos Serie B (CP) | Con ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | 13.24 | 12.49 | 11.99 |
| | | Amortización Final | - | 20/09/2022 | 20/12/2021 | 21/06/2021 |
| ISIN: ES0341068031 | Sin ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | - | - | - |
| | | Amortización Final | - | - | - | - |
| Bonos Serie B (CT) | Con ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | 13.24 | 12.49 | 11.99 |
| | | Amortización Final | - | 20/09/2022 | 20/12/2021 | 21/06/2021 |
| ISIN: ES0341068049 | Sin ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | - | - | - |
| | | Amortización Final | - | - | - | - |
| Bonos Serie C (CA) | Con ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | 13.24 | 12.49 | 11.99 |
| | | Amortización Final | - | 20/09/2022 | 20/12/2021 | 21/06/2021 |
| ISIN: ES0341068056 | Sin ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | - | - | - |
| | | Amortización Final | - | - | - | - |
| Bonos Serie C (CM) | Con ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | 13.24 | 12.49 | 11.99 |
| | | Amortización Final | - | 20/09/2022 | 20/12/2021 | 21/06/2021 |
| ISIN: ES0341068064 | Sin ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | - | - | - |
| | | Amortización Final | - | - | - | - |
| Bonos Serie C (CP) | Con ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | 13.24 | 12.49 | 11.99 |
| | | Amortización Final | - | 20/09/2022 | 20/12/2021 | 21/06/2021 |
| ISIN: ES0341068072 | Sin ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | - | - | - |
| | | Amortización Final | - | - | - | - |
| Bonos Serie C (CT) | Con ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | 13.24 | 12.49 | 11.99 |
| | | Amortización Final | - | 20/09/2022 | 20/12/2021 | 21/06/2021 |
| ISIN: ES0341068080 | Sin ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | - | - | - |
| | | Amortización Final | - | - | - | - |
| Bonos Serie D (CA) | Con ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | 13.24 | 12.49 | 11.99 |
| | | Amortización Final | - | 20/09/2022 | 20/12/2021 | 21/06/2021 |
| ISIN: ES0341068098 | Sin ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | - | - | - |
| | | Amortización Final | - | - | - | - |
| Bonos Serie D (CM) | Con ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | 13.24 | 12.49 | 11.99 |
| | | Amortización Final | - | 20/09/2022 | 20/12/2021 | 21/06/2021 |
| ISIN: ES0341068106 | Sin ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | - | - | - |
| | | Amortización Final | - | - | - | - |
| Bonos Serie D (CP) | Con ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | 13.24 | 12.49 | 11.99 |
| | | Amortización Final | - | 20/09/2022 | 20/12/2021 | 21/06/2021 |
| ISIN: ES0341068114 | Sin ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | - | - | - |
| | | Amortización Final | - | - | - | - |
| Bonos Serie D (CT) | Con ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | 13.24 | 12.49 | 11.99 |
| | | Amortización Final | - | 20/09/2022 | 20/12/2021 | 21/06/2021 |
| ISIN: ES0341068122 | Sin ejercicio amortización opcional | Vida Media (años) | - | - | - | - |
| | | Amortización Final | - | - | - | - |

Hipótesis WALRS (% de pérdida que experimentan las Ph's susceptibles de entrar en litigio) del 0,00% y WAFF (frecuencia de impago) del 0,00%.

⁽¹⁾ Amortización a opción de la Sociedad Gestora cuando el importe del principal pendiente de amortizar de las Participaciones Hipotecarias sea inferior al 10,00% del inicial y todas las obligaciones de pago de los bonos puedan ser atendidas y canceladas en su totalidad.



ACTIVO AGRUPADO: TIPO DE ACTIVO AGRUPADO

| General | Tipo de préstamos | |
|---|-------------------|-----------------------|
| | Actual | Fecha de Constitución |
| Principal | | |
| Número | 7.731 | 7.767 |
| Saldo Vivo | 349.631.008,28 € | 357.900.194,81 € |
| Medio | 45.202,08 € | 46.076,24 € |
| Mínimo | 2.287,22 € | 2.077,27 € |
| Máximo | 555.745,36 € | 562.528,17 € |
| Interés | | |
| Medio Ponderado | 3,9871% | 4,2939% |
| Mínimo | 2,9700% | 2,9700% |
| Máximo | 4,9080% | 5,0130% |
| Vida Residual (Meses) | | |
| Medio Ponderado | 170,22 | 173,01 |
| Mínimo | 3,35 | 6,77 |
| Máximo | 282,87 | 286,29 |
| Índice de Referencia (Distrib. en porcentaje sobre total de ppal PDTE) | | |
| Acuerdo consejo de ministros (90%) Mensual 98 | 30,44% | 30,59% |
| Acuerdo consejo de ministros (90%) Mensual 02-05 | 57,19% | 56,87% |
| Acuerdo consejo de ministros (90%) Mensual 05-08 | 4,09% | 4,00% |
| Acuerdo consejo de ministros (90%) Triennial 96 | 2,77% | 2,86% |
| Acuerdo consejo de ministros (90%) Triennial 97 | 3,25% | 3,30% |
| Acuerdo consejo de ministros (90%) Triennial 98 | 0,37% | 0,38% |
| Acuerdo consejo de ministros (90%) Triennial 95 | 1,62% | 1,69% |
| Acuerdo consejo de ministros (80%) Quinquennial 92 | 0,00% | 0,00% |
| Acuerdo consejo de ministros (90%) Quinquennial 94 | 0,27% | 0,30% |

AMORTIZACIÓN ANTICIPADA

| | Último mes | Últimos 3 meses | Últimos 6 meses | Últimos 12 meses | Histórica |
|-------------------------------|------------|-----------------|-----------------|------------------|-----------|
| Tasa Mensual Constante | 0,1388% | 0,1800% | - % | - % | 0,1793% |
| Tasa Anual Equivalente | 1,6535% | 2,1388% | - % | - % | 2,1299% |

DISTRIBUCIÓN GEOGRÁFICA

| | Actual | Fecha Constitución |
|----------------------|--------|--------------------|
| Catalunya | 76,45 | 76,52 |
| Madrid | 5,70 | 5,70 |
| Comunidad Valenciana | 4,07 | 4,06 |
| Baleares | 0,88 | 0,88 |
| Aragón | 0,09 | 0,10 |
| Andalucía | 3,08 | 3,04 |
| Murcia | 0,35 | 0,35 |
| Otras Comunidades | 9,39 | 9,35 |

MOROSIDAD ACTUAL

| Antigüedad | Número Participaciones Préstamos | Deuda Vencida | | | Deuda Pendiente Vencimiento | Deuda Total | | % Deuda Total/ Valor Tasación ⁽¹⁾ |
|----------------|----------------------------------|--------------------|--------------------|---------------------|-----------------------------|------------------------|----------------|--|
| | | Principal | Intereses y Otros | Total | | Principal | % | |
| Hasta 1 Mes | 336 | 67.811,68 € | 31.932,42 € | 99.744,10 € | 14.835.466,80 € | 14.903.278,48 € | 97,76% | 50,7696% |
| De 1 a 2 Meses | 5 | 3.381,58 € | 2.771,46 € | 6.153,04 € | 338.635,67 € | 342.017,25 € | 2,24% | 49,2557% |
| Totales | 341 | 71.193,26 € | 34.703,88 € | 105.897,14 € | 15.174.102,47 € | 15.245.295,73 € | 100,00% | 50,7344% |

(1) Tasación solo en Préstamos Hipotecarios

PRÉSTAMOS DE DUDOSO COBRO

| Antigüedad | Número Participaciones Préstamos | Deuda Vencida | | | Deuda Pendiente Vencimiento | Deuda Total | | % Deuda Total/ Valor Tasación ⁽¹⁾ |
|----------------|----------------------------------|---------------|-------------------|-------|-----------------------------|-------------|---|--|
| | | Principal | Intereses y Otros | Total | | Principal | % | |
| Totales | | | | | | | | |

(1) Tasación solo en Préstamos Hipotecarios



MEJORA CREDITICIA

| | Actual | | | A la emisión | | |
|-------------------------|--------|-------------------------|--------|--------------|-------------------------|--------|
| | %Bonos | Nominal | % MC | % Bonos | Nominal | % MC |
| SERIE AG | 89,55% | 324.840.234,52€ | 10,79% | 89,74% | 331.600.000,00€ | 10,59% |
| Serie B (CA) | 2,70% | 9.800.000,00€ | 8,00% | 2,65% | 9.800.000,00€ | 7,85% |
| Serie B (CM) | 0,91% | 3.300.000,00€ | 7,06% | 0,89% | 3.300.000,00€ | 6,93% |
| Serie B (CP) | 0,74% | 2.700.000,00€ | 6,29% | 0,73% | 2.700.000,00€ | 6,17% |
| Serie B (CT) | 0,55% | 2.000.000,00€ | 5,72% | 0,54% | 2.000.000,00€ | 5,62% |
| Serie C (CA) | 0,88% | 3.200.000,00€ | 4,81% | 0,87% | 3.200.000,00€ | 4,72% |
| Serie C (CM) | 0,63% | 2.300.000,00€ | 4,16% | 0,62% | 2.300.000,00€ | 4,08% |
| Serie C (CP) | 0,41% | 1.500.000,00€ | 3,73% | 0,41% | 1.500.000,00€ | 3,66% |
| Serie C (CT) | 0,41% | 1.500.000,00€ | 3,30% | 0,41% | 1.500.000,00€ | 3,24% |
| Serie D (CA) | 1,68% | 6.100.000,00€ | 0,00% | 1,65% | 6.100.000,00€ | 1,54% |
| Serie D (CM) | 0,69% | 2.500.000,00€ | 0,00% | 0,68% | 2.500.000,00€ | 0,84% |
| Serie D (CP) | 0,44% | 1.600.000,00€ | 0,00% | 0,43% | 1.600.000,00€ | 0,39% |
| Serie D (CT) | 0,39% | 1.400.000,00€ | 0,00% | 0,38% | 1.400.000,00€ | 0,00% |
| Total | | 362.740.234,52 € | | | 369.500.000,00 € | |
| Fondo de Reserva | 3,20% | 11.600.000,00€ | | 3,14% | 11.600.000,00€ | |

OTRAS OPERACIONES FINANCIERAS (Actual)

| | Saldo | Interés |
|---|-----------------|---------|
| Activo | | |
| CUENTA DE TESORERÍA | 13.900.144,48 € | 0,49% |
| CUENTA AGENTE DE PAGOS | 572.211,65 € | 0,49% |
| CUENTA TESORERÍA - AMORTIZACIÓN | 0,00 € | 0,00% |
| CUENTA RETENCIÓN DE PRINCIPALES | 0,00 € | 0,00% |
| CTA. TESOR. - COLATERIZACION SWAP | 0,00 € | 0,00% |
| LÍM. DISP. LÍNEA LIQUIDEZ | 0,00 € | 0,00% |
| Pasivo | | |
| PRÉSTAMO SUBORDINADO | 0,00 € | 0,00% |
| PRÉSTAMO GASTOS INICIALES | 3.283.085,09 € | 0,49% |
| IMPORTE DISPUESTO POR LÍNEA DE LIQUIDEZ | 0,00 € | 0,00% |
| AVAL ESTADO- DISPUESTO SERIES A1 (G) Y A2 (G) | 0,00 € | 0,00% |

OTRA INFORMACIÓN

| | Actual | A la emisión |
|---|----------|--------------|
| Pérdidas Acumuladas Evolutivas | 0,00 € | 0,00 € |
| Write-Off Acumulados | 0,00 € | 0,00 € |
| Recuperaciones sobre Write-Off acumuladas | 0,00 € | 0,00 € |
| Ratio de morosidad: Saldo Vivo Impagados > 90 días / Saldo Vivo Total | 0,0000% | 0,0000% |
| Media Ponderada Principal / Valor de Tasación (P/VT) (1) | 57,0595% | 57,8219% |
| Déficit amortización o Dotación bonos | 0,00 € | 0,00 € |

INFORMACIÓN PERIODO EN ESPERA

| | |
|--|---------|
| Saldo Vivo Ph's periodo en espera | |
| Intereses Devengados | |
| Ratio: (Saldo vivo GE + Intereses Devengados) / Saldo Vivo Total | 0,0000% |

PERMUTAS INTERÉS (Swap)

| Swap | Principal Nocial | Interés |
|----------|------------------|--------------|
| Receptor | A Determinar | 1,766000% |
| Pagador | A Determinar | A Determinar |

ADQUISICIÓN DE DERECHOS DE CRÉDITO ADICIONALES

Última adquisición

| | |
|---|---|
| Fecha | |
| Número de derechos de crédito adquiridos | 0 |
| Principal derechos de crédito adicionales | |
| <u>Acumulado de adquisiciones</u> | |
| Número de derechos de crédito adquiridos | 0 |
| Principal derechos de crédito adicionales | |

Próxima adquisición

Vencimiento teórico periodo de recarga

INFORMACIÓN ADICIONAL EN:

Sociedad Gestora: Gestión de Activos Titulizados, SGFT, S.A. c/ Fontanella 5-7, Barcelona Tel. 93 484 73 36 - FAX: 93 484 73 41 info@gat-sgft.com www.gat-sgft.info
 Registro Oficial: Comisión Nacional del Mercado de Valores Passeig de Gràcia 16, Barcelona

RESPONSABILIDAD CONTENIDO INFORMACIÓN: Gestión de Activos Titulizados, SGFT, S.A.

EL DIRECTOR EJECUTIVO