

I. AyT.4 FTA: Datos generales sobre el Fondo.

Fecha Constitución del Fondo	6 de abril de 2001
Fecha Primera Emisión Pagarés	17 de abril de 2001
Fecha Extinción y Liquidación del Fondo	30 de noviembre de 2014
Sociedad Gestora	Ahorro y Titulización S.G.F.T., S.A.
Entidad Directora y Aseguradora	Caja de Ahorros y Monte de Piedad de Madrid
Entidades Cedentes	Caja de Ahorros de Guipúzcoa y San Sebastián Caja de Ahorros de Vitoria y Álava Caja de Ahorros de La Rioja
Entidades Participantes	Ahorro Corporación Financiera, S.V.B., S.A. Confederación Española de Cajas de Ahorro Caja de Ahorros y Monte de Piedad de Madrid Société Générale, Sucursal en España Invercaixa Valores, S.V.B., S.A. Crédit Agricole Indosuez Caja de Ahorros de La Rioja Bankinter, S.A.
Agente de Pagos	Confederación Española de Cajas de Ahorros
Negociación Mercado	AIAF
Agencia de Calificación	Moody's Investors Service España, S.A.

II. Valores emitidos por el Fondo: PAGARÉS

SALDO VIVO DE LOS PAGARÉS A 30 de SEPTIEMBRE de 2003

Código ISIN	Fecha de Emisión	Fecha de Vencimiento	Importe de la Emisión	Precio Medio	Interés Medio
ES0512407513	17-jul-03	17-oct-03	5.000.000	99,459	2,128
ES0512407547	17-sep-03	17-nov-03	11.000.000	99,634	2,168
ES0512407554	17-sep-03	17-dic-03	7.500.000	99,455	2,168
ES0512407505	17-jul-03	16-ene-04	3.800.000	99,948	2,092
ES0512407539	17-sep-03	17-feb-04	5.000.000	99,027	2,312
ES0512407521	17-sep-03	17-mar-04	24.000.000	98,852	2,297
Total			56.300.000	99,228	2,227

- Préstamo Subordinado

Saldo Vivo Tramo A	7.472.959,10
Saldo Vivo Tramo B	11.500.000,00

Fondo de Reserva	7.200.000,00
------------------	--------------

III. Valores adquiridos por el Fondo. Información sobre los activos:

Saldo Vivo Activos	67.781.731,95
Intereses devengados no vencidos*	287.265,03
Intereses cobrados*	1.200.087,13
Tipo Medio Activos	2,671 %
Vida Media Activos	3,201 años

(*) en el periodo

- Morosidad Actual de la Cartera de Activos

Total Impagados	%sobre Saldo Vivo de los Activos
0,00	0,00 %

Total Fallidos	%sobre Saldo Vivo de los Activos
0,00	0,00 %

- Distribución de la Cartera por Índice de Referencia

	Nº Préstamos	Saldo Vivo Activos	% sobre Saldo Vivo Activos	Tipo Medio
CECA	2	256.744,32	0,38 %	5,50 %
Mibor	18	44.688.953,70	65,93 %	2,59 %
Euribor	16	16.488.134,02	24,33 %	2,98 %
Libor	2	6.347.899,91	9,37 %	2,34 %
Total	38	67.781.731,95	100%	

- Distribución de la Cartera por tipo de préstamo

	Nº Préstamos	Saldo Vivo Activos	% sobre S.V. Activos
Grandes Empresas	5	4.346.008,55	6,41 %
Pymes	11	8.780.351,84	12,95 %
Sindicados	22	54.655.371,56	80,63 %
Total	38	67.781.731,95	100%

- Distribución de la Cartera por área geográfica

	Nº Préstamos	Saldo Vivo Activos	% sobre S.V. Activos
Álava	6	5.153.578,58	7,60 %
Barcelona	1	3.005.060,52	4,43 %
Guipúzcoa	10	7.972.781,81	11,76 %
La Rioja	3	2.707.551,46	3,99 %
Madrid	8	32.043.857,85	47,28 %
Tarragona	5	1.314.287,19	1,94 %
Valencia	1	1.347.899,91	1,99 %
Vizcaya	2	8.005.060,52	11,81 %
Otros	2	6.231.654,11	9,20 %
Total	38	67.781.731,95	100%

- Distribución de la Cartera por Saldo Vivo de la entidad cedente

	Nº Préstamos	% del total de préstamos	Saldo Vivo Activos	% sobre Saldo Vivo Activos
Caja Vital	9	23,68 %	30.381.432,20	44,82 %
Caja Rioja	18	47,37 %	28.619.947,91	42,22 %
Kutxa	11	28,95 %	8.780.351,84	12,95 %
Total	38	100%	67.781.731,95	100%