

Barcelona, 27 de Octubre de 2009

COMISIÓN NACIONAL DEL MERCADO DE VALORES

Passeig de Gràcia, 19

08007 Barcelona

Asunto: Gat Ftgencat 2006 Fondo de Titulización de Activos

Con relación al fondo de referencia les adjuntamos la siguiente información periódica correspondiente al 15 de Septiembre de 2009, fecha de pago de intereses y de reembolso por amortización de principal de los emitidos con cargo al Fondo.

- Estados de los Bonos de Titulización al 15/09/2009:
 - Emisión de Bonos de la Serie A1 (ISIN: ES0341097006)
 - Emisión de Bonos de la Serie A2 (G) (ISIN: ES0341097014)
 - Emisión de Bonos de la Serie B (ISIN: ES0341097022)
 - Emisión de Bonos de la Serie C (ISIN: ES0341097030)
 - Emisión de Bonos de la Serie D (ISIN: ES0341097048)
 - Emisión de Bonos de la Serie E (ISIN: ES0341097055)
 - Vida media y amortización final calculadas con la hipótesis de mantenimiento de la tasa de amortización anticipada real experimentada por los Préstamos Hipotecarios Participados durante el último trimestre
- Estados de la cartera de Participaciones Hipotecarias al 31/08/2009:
 - Clasificación por los índices de referencia del tipo de interés.
 - Situación de impagados y fallidos: clasificación por tramos de antigüedad de la primera cuota vencida y no pagada de cada préstamo.
 - Situación de impagados y fallidos: clasificación por tramos de antigüedad de cada cuota vencida y no pagada de los préstamos.
 - Amortización anticipada y tasa de amortización anticipada real.
- Estado de origen y aplicación de los fondos disponibles correspondientes a la Fecha de Pago 15/09/2009.

Atentamente.



Carles Fruns Moncunill

Director General

GESTIÓN DE ACTIVOS TITULIZADOS SGFT S.A.

Anexo: Documentación que se cita. (24 hojas)

Bonos Titulización de Activos SERIE A1

Número de Bonos: 1.703											PROMEMORIA		
Código ISIN: ES0341097006											Amortización Bonos		
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			
15/09/2008	5,0280%	96,88 €	79,44 €	164.986,64 €	0,00	7.622,64 €	0,00 €	0,00%	12.981.355,92 €	0,00 €	18.024.811,77 €	18.024.811,77 €	0,00 €
16/06/2008	4,6760%	233,83 €	191,74 €	398.212,49 €	0,00	12.160,06 €	7.622,64 €	7,62%	20.708.582,18 €	12.981.355,92 €	20.708.582,18 €	20.708.582,18 €	0,00 €
17/03/2008	5,0180%	406,63 €	333,44 €	692.490,89 €	0,00	12.274,57 €	19.782,70 €	19,78%	20.903.592,71 €	33.689.938,10 €	20.903.592,71 €	20.903.592,71 €	0,00 €
17/12/2007	4,8000%	551,93 €	452,58 €	939.936,79 €	0,00	13.431,60 €	32.057,27 €	32,06%	22.874.014,80 €	54.593.530,81 €	22.874.014,80 €	22.874.014,80 €	0,00 €
17/09/2007	4,2150%	649,66 €	532,72 €	1.106.370,98 €	0,00	13.539,72 €	45.488,87 €	45,49%	23.058.143,16 €	77.467.545,61 €	23.058.143,16 €	23.058.143,16 €	0,00 €
15/06/2007	3,9590%	742,46 €	608,82 €	1.264.409,38 €	0,00	14.355,63 €	59.028,59 €	59,03%	24.447.637,89 €	100.525.688,77 €	24.447.637,89 €	24.447.637,89 €	0,00 €
15/03/2007	3,7440%	819,81 €	672,24 €	1.396.136,43 €	0,00	14.202,07 €	73.384,22 €	73,38%	24.186.125,21 €	124.973.326,66 €	24.186.125,21 €	24.186.125,21 €	0,00 €
15/12/2006	3,4470%	679,83 €	577,86 €	1.157.750,49 €	0,00	12.413,71 €	87.586,29 €	87,59%	21.140.548,13 €	149.159.451,87 €	21.140.548,13 €	21.140.548,13 €	0,00 €
05/10/2006							100.000,00 €			170.300.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos SERIE A2G

Número de Bonos: 2.391 Código ISIN: ES0341097014											PROMEMORIA		
											Amortización Bonos		
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			
15/09/2009	1,3280%	246,18 €	201,87 €	588.616,38 €	0,00	6.741,09 €	65.796,39 €	65,80%	16.117.946,19 €	157.319.168,49 €	16.117.946,19 €	16.117.946,19 €	0,00 €
15/06/2009	1,6950%	354,04 €	290,31 €	846.509,64 €	0,00	10.093,02 €	72.537,48 €	72,54%	24.132.410,82 €	173.437.114,68 €	24.132.410,82 €	24.132.410,82 €	0,00 €
16/03/2009	3,3740%	766,62 €	628,63 €	1.832.988,42 €	0,00	7.256,93 €	82.630,50 €	82,63%	17.351.319,63 €	197.569.525,50 €	17.351.319,63 €	17.351.319,63 €	0,00 €
15/12/2008	5,0030%	1.237,97 €	1.015,14 €	2.959.986,27 €	0,00	8.003,22 €	89.887,43 €	89,89%	19.135.699,02 €	214.920.845,13 €	19.135.699,02 €	19.135.699,02 €	0,00 €
15/09/2008	5,0030%	1.264,65 €	1.037,01 €	3.023.778,15 €	0,00	2.109,35 €	97.890,65 €	97,89%	5.043.455,85 €	234.056.544,15 €	18.024.811,77 €	18.024.811,77 €	0,00 €
16/06/2008	4,6510%	1.175,67 €	964,05 €	2.811.026,97 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	239.100.000,00 €	20.708.582,18 €	20.708.582,18 €	0,00 €
17/03/2008	4,9930%	1.262,12 €	1.034,94 €	3.017.728,92 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	239.100.000,00 €	20.903.592,71 €	20.903.592,71 €	0,00 €
17/12/2007	4,7750%	1.207,01 €	989,75 €	2.885.960,91 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	239.100.000,00 €	22.874.014,80 €	22.874.014,80 €	0,00 €
17/09/2007	4,1900%	1.094,06 €	897,13 €	2.615.897,46 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	239.100.000,00 €	23.058.143,16 €	23.058.143,16 €	0,00 €
15/06/2007	3,9340%	1.005,36 €	824,40 €	2.403.815,76 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	239.100.000,00 €	24.447.637,89 €	24.447.637,89 €	0,00 €
15/03/2007	3,7190%	929,75 €	762,40 €	2.223.032,25 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	239.100.000,00 €	24.186.125,21 €	24.186.125,21 €	0,00 €
15/12/2006	3,4220%	674,89 €	573,66 €	1.613.661,99 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	239.100.000,00 €	21.140.548,13 €	21.140.548,13 €	0,00 €
05/10/2006							100.000,00 €			239.100.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos SERIE B

Número de Bonos: 51											PROMEMORIA		
Código ISIN: ES0341097022											Amortización Bonos		
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			
15/09/2009	1,4830%	378,99 €	310,77 €	19.328,49 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	16.117.946,19 €	16.117.946,19 €	0,00 €
15/06/2009	1,8500%	467,64 €	383,46 €	23.849,64 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	24.132.410,82 €	24.132.410,82 €	0,00 €
16/03/2009	3,5290%	892,05 €	731,48 €	45.494,55 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	17.351.319,63 €	17.351.319,63 €	0,00 €
15/12/2008	5,1580%	1.303,83 €	1.069,14 €	66.495,33 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	19.135.699,02 €	19.135.699,02 €	0,00 €
15/09/2008	5,1580%	1.303,83 €	1.069,14 €	66.495,33 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	18.024.811,77 €	18.024.811,77 €	0,00 €
16/06/2008	4,8060%	1.214,85 €	996,18 €	61.957,35 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	20.708.582,18 €	20.708.582,18 €	0,00 €
17/03/2008	5,1480%	1.301,30 €	1.067,07 €	66.366,30 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	20.903.592,71 €	20.903.592,71 €	0,00 €
17/12/2007	4,9300%	1.246,19 €	1.021,88 €	63.555,69 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	22.874.014,80 €	22.874.014,80 €	0,00 €
17/09/2007	4,3450%	1.134,53 €	930,31 €	57.861,03 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	23.058.143,16 €	23.058.143,16 €	0,00 €
15/06/2007	4,0890%	1.044,97 €	856,88 €	53.293,47 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	24.447.637,89 €	24.447.637,89 €	0,00 €
15/03/2007	3,8740%	968,50 €	794,17 €	49.393,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	24.186.125,21 €	24.186.125,21 €	0,00 €
15/12/2006	3,5770%	705,46 €	599,64 €	35.978,46 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	21.140.548,13 €	21.140.548,13 €	0,00 €
05/10/2006							100.000,00 €			5.100.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos SERIE C

Número de Bonos: 123 Código ISIN: ES0341097030											PROMEMORIA		
											Amortización Bonos		
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			
15/09/2009	1,5830%	404,54 €	331,72 €	49.758,42 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	16.117.946,19 €	16.117.946,19 €	0,00 €
15/06/2009	1,9500%	492,92 €	404,19 €	60.629,16 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	24.132.410,82 €	24.132.410,82 €	0,00 €
16/03/2009	3,6290%	917,33 €	752,21 €	112.831,59 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	17.351.319,63 €	17.351.319,63 €	0,00 €
15/12/2008	5,2580%	1.329,11 €	1.089,87 €	163.480,53 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	19.135.699,02 €	19.135.699,02 €	0,00 €
15/09/2008	5,2580%	1.329,11 €	1.089,87 €	163.480,53 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	18.024.811,77 €	18.024.811,77 €	0,00 €
16/06/2008	4,9060%	1.240,13 €	1.016,91 €	152.535,99 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	20.708.582,18 €	20.708.582,18 €	0,00 €
17/03/2008	5,2480%	1.326,58 €	1.087,80 €	163.169,34 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	20.903.592,71 €	20.903.592,71 €	0,00 €
17/12/2007	5,0300%	1.271,47 €	1.042,61 €	156.390,81 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	22.874.014,80 €	22.874.014,80 €	0,00 €
17/09/2007	4,4450%	1.160,64 €	951,72 €	142.758,72 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	23.058.143,16 €	23.058.143,16 €	0,00 €
15/06/2007	4,1890%	1.070,52 €	877,83 €	131.673,96 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	24.447.637,89 €	24.447.637,89 €	0,00 €
15/03/2007	3,9740%	993,50 €	814,67 €	122.200,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	24.186.125,21 €	24.186.125,21 €	0,00 €
15/12/2006	3,6770%	725,19 €	616,41 €	89.198,37 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	21.140.548,13 €	21.140.548,13 €	0,00 €
05/10/2006							100.000,00 €			12.300.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos SERIE D

Número de Bonos: 132											PROMEMORIA		
Código ISIN: ES0341097048											Amortización Bonos		
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			
15/09/2009	1,9330%	493,99 €	405,07 €	65.206,68 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	16.117.946,19 €	16.117.946,19 €	0,00 €
15/06/2009	2,3000%	581,39 €	476,74 €	76.743,48 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	24.132.410,82 €	24.132.410,82 €	0,00 €
16/03/2009	3,9790%	1.005,80 €	824,76 €	132.765,60 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	17.351.319,63 €	17.351.319,63 €	0,00 €
15/12/2008	5,6080%	1.417,58 €	1.162,42 €	187.120,56 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	19.135.699,02 €	19.135.699,02 €	0,00 €
15/09/2008	5,6080%	1.417,58 €	1.162,42 €	187.120,56 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	18.024.811,77 €	18.024.811,77 €	0,00 €
16/06/2008	5,2560%	1.328,60 €	1.089,45 €	175.375,20 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	20.708.582,18 €	20.708.582,18 €	0,00 €
17/03/2008	5,5980%	1.415,05 €	1.160,34 €	186.786,60 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	20.903.592,71 €	20.903.592,71 €	0,00 €
17/12/2007	5,3800%	1.359,94 €	1.115,15 €	179.512,08 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	22.874.014,80 €	22.874.014,80 €	0,00 €
17/09/2007	4,7950%	1.252,03 €	1.026,66 €	165.267,96 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	23.058.143,16 €	23.058.143,16 €	0,00 €
15/06/2007	4,5390%	1.159,97 €	951,18 €	153.116,04 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	24.447.637,89 €	24.447.637,89 €	0,00 €
15/03/2007	4,3240%	1.081,00 €	886,42 €	142.692,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	24.186.125,21 €	24.186.125,21 €	0,00 €
15/12/2006	4,0270%	794,21 €	675,08 €	104.835,72 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	21.140.548,13 €	21.140.548,13 €	0,00 €
05/10/2006							100.000,00 €			13.200.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos SERIE E

Número de Bonos: 95											PROMEMORIA		
Código ISIN: ES0341097055											Amortización Bonos		
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			
15/09/2009	5,7830%	1.477,88 €	1.211,86 €	0,00 €	140.398,60 €	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	16.117.946,19 €	16.117.946,19 €	0,00 €
15/06/2009	6,1500%	1.554,58 €	1.274,76 €	0,00 €	147.685,10	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	24.132.410,82 €	24.132.410,82 €	0,00 €
16/03/2009	7,8290%	1.979,00 €	1.622,78 €	0,00 €	188.005,00 €	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	17.351.319,63 €	17.351.319,63 €	0,00 €
15/12/2008	9,4580%	2.390,77 €	1.960,43 €	0,00 €	227.123,15 €	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	19.135.699,02 €	19.135.699,02 €	0,00 €
15/09/2008	9,4580%	2.390,77 €	1.960,43 €	0,00 €	227.123,15	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	18.024.811,77 €	18.024.811,77 €	0,00 €
16/06/2008	9,1060%	4.690,03 €	3.845,82 €	445.552,85 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	20.708.582,18 €	20.708.582,18 €	0,00 €
17/03/2008	9,4480%	2.388,24 €	1.958,36 €	0,00 €	226.882,80	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	20.903.592,71 €	20.903.592,71 €	0,00 €
17/12/2007	9,2300%	2.333,14 €	1.913,17 €	221.648,30 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	22.874.014,80 €	22.874.014,80 €	0,00 €
17/09/2007	8,6450%	2.257,31 €	1.850,99 €	214.444,45 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	23.058.143,16 €	23.058.143,16 €	0,00 €
15/06/2007	8,3890%	2.143,86 €	1.757,97 €	203.666,70 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	24.447.637,89 €	24.447.637,89 €	0,00 €
15/03/2007	8,1740%	2.043,50 €	1.675,67 €	194.132,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	24.186.125,21 €	24.186.125,21 €	0,00 €
15/12/2006	7,8770%	1.553,52 €	1.320,49 €	147.584,40 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	21.140.548,13 €	21.140.548,13 €	0,00 €
05/10/2006							100.000,00 €			9.500.000,00 €			

Mortgage Securitisation Bonds SERIE A1

Number of bonds: 1.703 ISIN number: ES0341097006											EXPLANATORY MEMORANDUM		
											Amortisation Bonds		
Date of payment	% Nominal rate	Cupon per bond		Total interests		Amortisation per bond			Total amortisation		Principal accrued amortisation	Principal amortised	Recovery deficit account
		Gross	Net	Paid	Unpaid	Amortised	Principal outstanding	% of issue	Amortised	principal outstanding			
15/09/2008	5,0280%	96,88 €	79,44 €	164.986,64 €	0,00	7.622,64 €	0,00 €	0,00%	12.981.355,92 €	0,00 €	18.024.811,77 €	18.024.811,77 €	0,00 €
16/06/2008	4,6760%	233,83 €	191,74 €	398.212,49 €	0,00	12.160,06 €	7.622,64 €	7,62%	20.708.582,18 €	12.981.355,92 €	20.708.582,18 €	20.708.582,18 €	0,00 €
17/03/2008	5,0180%	406,63 €	333,44 €	692.490,89 €	0,00	12.274,57 €	19.782,70 €	19,78%	20.903.592,71 €	33.689.938,10 €	20.903.592,71 €	20.903.592,71 €	0,00 €
17/12/2007	4,8000%	551,93 €	452,58 €	939.936,79 €	0,00	13.431,60 €	32.057,27 €	32,06%	22.874.014,80 €	54.593.530,81 €	22.874.014,80 €	22.874.014,80 €	0,00 €
17/09/2007	4,2150%	649,66 €	532,72 €	1.106.370,98 €	0,00	13.539,72 €	45.488,87 €	45,49%	23.058.143,16 €	77.467.545,61 €	23.058.143,16 €	23.058.143,16 €	0,00 €
15/06/2007	3,9590%	742,46 €	608,82 €	1.264.409,38 €	0,00	14.355,63 €	59.028,59 €	59,03%	24.447.637,89 €	100.525.688,77 €	24.447.637,89 €	24.447.637,89 €	0,00 €
15/03/2007	3,7440%	819,81 €	672,24 €	1.396.136,43 €	0,00	14.202,07 €	73.384,22 €	73,38%	24.186.125,21 €	124.973.326,66 €	24.186.125,21 €	24.186.125,21 €	0,00 €
15/12/2006	3,4470%	679,83 €	577,86 €	1.157.750,49 €	0,00	12.413,71 €	87.586,29 €	87,59%	21.140.548,13 €	149.159.451,87 €	21.140.548,13 €	21.140.548,13 €	0,00 €
05/10/2006							100.000,00 €			170.300.000,00 €			

Mortgage Securitisation Bonds SERIE A2G

Number of bonds: 2.391 ISIN number: ES0341097014											EXPLANATORY MEMORANDUM		
											Amortisation Bonds		
Date of payment	% Nominal rate	Cupon per bond		Total interests		Amortisation per bond			Total amortisation		Principal accrued amortisation	Principal amortised	Recovery deficit account
		Gross	Net	Paid	Unpaid	Amortised	Principal outstanding	% of issue	Amortised	principal outstanding			
15/09/2009	1,3280%	246,18 €	201,87 €	588.616,38 €	0,00	6.741,09 €	65.796,39 €	65,80%	16.117.946,19 €	157.319.168,49 €	16.117.946,19 €	16.117.946,19 €	0,00 €
15/06/2009	1,6950%	354,04 €	290,31 €	846.509,64 €	0,00	10.093,02 €	72.537,48 €	72,54%	24.132.410,82 €	173.437.114,68 €	24.132.410,82 €	24.132.410,82 €	0,00 €
16/03/2009	3,3740%	766,62 €	628,63 €	1.832.988,42 €	0,00	7.256,93 €	82.630,50 €	82,63%	17.351.319,63 €	197.569.525,50 €	17.351.319,63 €	17.351.319,63 €	0,00 €
15/12/2008	5,0030%	1.237,97 €	1.015,14 €	2.959.986,27 €	0,00	8.003,22 €	89.887,43 €	89,89%	19.135.699,02 €	214.920.845,13 €	19.135.699,02 €	19.135.699,02 €	0,00 €
15/09/2008	5,0030%	1.264,65 €	1.037,01 €	3.023.778,15 €	0,00	2.109,35 €	97.890,65 €	97,89%	5.043.455,85 €	234.056.544,15 €	18.024.811,77 €	18.024.811,77 €	0,00 €
16/06/2008	4,6510%	1.175,67 €	964,05 €	2.811.026,97 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	239.100.000,00 €	20.708.582,18 €	20.708.582,18 €	0,00 €
17/03/2008	4,9930%	1.262,12 €	1.034,94 €	3.017.728,92 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	239.100.000,00 €	20.903.592,71 €	20.903.592,71 €	0,00 €
17/12/2007	4,7750%	1.207,01 €	989,75 €	2.885.960,91 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	239.100.000,00 €	22.874.014,80 €	22.874.014,80 €	0,00 €
17/09/2007	4,1900%	1.094,06 €	897,13 €	2.615.897,46 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	239.100.000,00 €	23.058.143,16 €	23.058.143,16 €	0,00 €
15/06/2007	3,9340%	1.005,36 €	824,40 €	2.403.815,76 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	239.100.000,00 €	24.447.637,89 €	24.447.637,89 €	0,00 €
15/03/2007	3,7190%	929,75 €	762,40 €	2.223.032,25 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	239.100.000,00 €	24.186.125,21 €	24.186.125,21 €	0,00 €
15/12/2006	3,4220%	674,89 €	573,66 €	1.613.661,99 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	239.100.000,00 €	21.140.548,13 €	21.140.548,13 €	0,00 €
05/10/2006							100.000,00 €			239.100.000,00 €			

Mortgage Securitisation Bonds SERIE B

Number of bonds: 51 ISIN number: ES0341097022											EXPLANATORY MEMORANDUM		
											Amortisation Bonds		
Date of payment	% Nominal rate	Cupon per bond		Total interests		Amortisation per bond			Total amortisation		Principal accrued amortisation	Principal amortised	Recovery deficit account
		Gross	Net	Paid	Unpaid	Amortised	Principal outstanding	% of issue	Amortised	principal outstanding			
15/09/2009	1,4830%	378,99 €	310,77 €	19.328,49 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	16.117.946,19 €	16.117.946,19 €	0,00 €
15/06/2009	1,8500%	467,64 €	383,46 €	23.849,64 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	24.132.410,82 €	24.132.410,82 €	0,00 €
16/03/2009	3,5290%	892,05 €	731,48 €	45.494,55 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	17.351.319,63 €	17.351.319,63 €	0,00 €
15/12/2008	5,1580%	1.303,83 €	1.069,14 €	66.495,33 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	19.135.699,02 €	19.135.699,02 €	0,00 €
15/09/2008	5,1580%	1.303,83 €	1.069,14 €	66.495,33 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	18.024.811,77 €	18.024.811,77 €	0,00 €
16/06/2008	4,8060%	1.214,85 €	996,18 €	61.957,35 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	20.708.582,18 €	20.708.582,18 €	0,00 €
17/03/2008	5,1480%	1.301,30 €	1.067,07 €	66.366,30 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	20.903.592,71 €	20.903.592,71 €	0,00 €
17/12/2007	4,9300%	1.246,19 €	1.021,88 €	63.555,69 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	22.874.014,80 €	22.874.014,80 €	0,00 €
17/09/2007	4,3450%	1.134,53 €	930,31 €	57.861,03 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	23.058.143,16 €	23.058.143,16 €	0,00 €
15/06/2007	4,0890%	1.044,97 €	856,88 €	53.293,47 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	24.447.637,89 €	24.447.637,89 €	0,00 €
15/03/2007	3,8740%	968,50 €	794,17 €	49.393,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	24.186.125,21 €	24.186.125,21 €	0,00 €
15/12/2006	3,5770%	705,46 €	599,64 €	35.978,46 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	5.100.000,00 €	21.140.548,13 €	21.140.548,13 €	0,00 €
05/10/2006							100.000,00 €			5.100.000,00 €			

Mortgage Securitisation Bonds SERIE C

Number of bonds: 123 ISIN number: ES0341097030											EXPLANATORY MEMORANDUM		
											Amortisation Bonds		
Date of payment	% Nominal rate	Cupon per bond		Total interests		Amortisation per bond			Total amortisation		Principal accrued amortisation	Principal amortised	Recovery deficit account
		Gross	Net	Paid	Unpaid	Amortised	Principal outstanding	% of issue	Amortised	principal outstanding			
15/09/2009	1,5830%	404,54 €	331,72 €	49.758,42 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	16.117.946,19 €	16.117.946,19 €	0,00 €
15/06/2009	1,9500%	492,92 €	404,19 €	60.629,16 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	24.132.410,82 €	24.132.410,82 €	0,00 €
16/03/2009	3,6290%	917,33 €	752,21 €	112.831,59 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	17.351.319,63 €	17.351.319,63 €	0,00 €
15/12/2008	5,2580%	1.329,11 €	1.089,87 €	163.480,53 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	19.135.699,02 €	19.135.699,02 €	0,00 €
15/09/2008	5,2580%	1.329,11 €	1.089,87 €	163.480,53 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	18.024.811,77 €	18.024.811,77 €	0,00 €
16/06/2008	4,9060%	1.240,13 €	1.016,91 €	152.535,99 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	20.708.582,18 €	20.708.582,18 €	0,00 €
17/03/2008	5,2480%	1.326,58 €	1.087,80 €	163.169,34 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	20.903.592,71 €	20.903.592,71 €	0,00 €
17/12/2007	5,0300%	1.271,47 €	1.042,61 €	156.390,81 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	22.874.014,80 €	22.874.014,80 €	0,00 €
17/09/2007	4,4450%	1.160,64 €	951,72 €	142.758,72 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	23.058.143,16 €	23.058.143,16 €	0,00 €
15/06/2007	4,1890%	1.070,52 €	877,83 €	131.673,96 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	24.447.637,89 €	24.447.637,89 €	0,00 €
15/03/2007	3,9740%	993,50 €	814,67 €	122.200,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	24.186.125,21 €	24.186.125,21 €	0,00 €
15/12/2006	3,6770%	725,19 €	616,41 €	89.198,37 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	12.300.000,00 €	21.140.548,13 €	21.140.548,13 €	0,00 €
05/10/2006							100.000,00 €			12.300.000,00 €			

Mortgage Securitisation Bonds SERIE D

Number of bonds: 132 ISIN number: ES0341097048											EXPLANATORY MEMORANDUM		
											Amortisation Bonds		
Date of payment	% Nominal rate	Cupon per bond		Total interests		Amortisation per bond			Total amortisation		Principal accrued amortisation	Principal amortised	Recovery deficit account
		Gross	Net	Paid	Unpaid	Amortised	Principal outstanding	% of issue	Amortised	principal outstanding			
15/09/2009	1,9330%	493,99 €	405,07 €	65.206,68 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	16.117.946,19 €	16.117.946,19 €	0,00 €
15/06/2009	2,3000%	581,39 €	476,74 €	76.743,48 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	24.132.410,82 €	24.132.410,82 €	0,00 €
16/03/2009	3,9790%	1.005,80 €	824,76 €	132.765,60 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	17.351.319,63 €	17.351.319,63 €	0,00 €
15/12/2008	5,6080%	1.417,58 €	1.162,42 €	187.120,56 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	19.135.699,02 €	19.135.699,02 €	0,00 €
15/09/2008	5,6080%	1.417,58 €	1.162,42 €	187.120,56 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	18.024.811,77 €	18.024.811,77 €	0,00 €
16/06/2008	5,2560%	1.328,60 €	1.089,45 €	175.375,20 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	20.708.582,18 €	20.708.582,18 €	0,00 €
17/03/2008	5,5980%	1.415,05 €	1.160,34 €	186.786,60 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	20.903.592,71 €	20.903.592,71 €	0,00 €
17/12/2007	5,3800%	1.359,94 €	1.115,15 €	179.512,08 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	22.874.014,80 €	22.874.014,80 €	0,00 €
17/09/2007	4,7950%	1.252,03 €	1.026,66 €	165.267,96 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	23.058.143,16 €	23.058.143,16 €	0,00 €
15/06/2007	4,5390%	1.159,97 €	951,18 €	153.116,04 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	24.447.637,89 €	24.447.637,89 €	0,00 €
15/03/2007	4,3240%	1.081,00 €	886,42 €	142.692,00 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	24.186.125,21 €	24.186.125,21 €	0,00 €
15/12/2006	4,0270%	794,21 €	675,08 €	104.835,72 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	13.200.000,00 €	21.140.548,13 €	21.140.548,13 €	0,00 €
05/10/2006							100.000,00 €			13.200.000,00 €			

Mortgage Securitisation Bonds SERIE E

Number of bonds: 95 ISIN number: ES0341097055											EXPLANATORY MEMORANDUM		
											Amortisation Bonds		
Date of payment	% Nominal rate	Coupon per bond		Total interests		Amortisation per bond			Total amortisation		Principal accrued amortisation	Principal amortised	Recovery deficit account
		Gross	Net	Paid	Unpaid	Amortised	Principal outstanding	% of issue	Amortised	principal outstanding			
15/09/2009	5,7830%	1.477,88 €	1.211,86 €	0,00 €	140.398,60	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	16.117.946,19 €	16.117.946,19 €	0,00 €
15/06/2009	6,1500%	1.554,58 €	1.274,76 €	0,00 €	147.685,10 €	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	24.132.410,82 €	24.132.410,82 €	0,00 €
16/03/2009	7,8290%	1.979,00 €	1.622,78 €	0,00 €	188.005,00 €	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	17.351.319,63 €	17.351.319,63 €	0,00 €
15/12/2008	9,4580%	2.390,77 €	1.960,43 €	0,00 €	227.123,15 €	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	19.135.699,02 €	19.135.699,02 €	0,00 €
15/09/2008	9,4580%	2.390,77 €	1.960,43 €	0,00 €	227.123,15	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	18.024.811,77 €	18.024.811,77 €	0,00 €
16/06/2008	9,1060%	4.690,03 €	3.845,82 €	445.552,85 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	20.708.582,18 €	20.708.582,18 €	0,00 €
17/03/2008	9,4480%	2.388,24 €	1.958,36 €	0,00 €	226.882,80	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	20.903.592,71 €	20.903.592,71 €	0,00 €
17/12/2007	9,2300%	2.333,14 €	1.913,17 €	221.648,30 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	22.874.014,80 €	22.874.014,80 €	0,00 €
17/09/2007	8,6450%	2.257,31 €	1.850,99 €	214.444,45 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	23.058.143,16 €	23.058.143,16 €	0,00 €
15/06/2007	8,3890%	2.143,86 €	1.757,97 €	203.666,70 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	24.447.637,89 €	24.447.637,89 €	0,00 €
15/03/2007	8,1740%	2.043,50 €	1.675,67 €	194.132,50 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	24.186.125,21 €	24.186.125,21 €	0,00 €
15/12/2006	7,8770%	1.553,52 €	1.320,49 €	147.584,40 €	0,00	0,00 €	100.000,00 €	100,00%	0,00 €	9.500.000,00 €	21.140.548,13 €	21.140.548,13 €	0,00 €
05/10/2006							100.000,00 €			9.500.000,00 €			

Bonos Titulización de Activos al día 31/08/2009

Vida media y amortización final estimados según diferentes tasas constantes de amortización anticipada de cada trimestre

TASA AMORTIZACIÓN ANTICIPADA		INICIAL	30/11/2008	28/02/2009	31/05/2009	31/08/2009
% mensual constante		0,340%	0,411%	0,397%	0,419%	0,408%
% anual constante		4,000%	4,825%	4,660%	4,911%	4,789%
BONOS SERIE A1 (ISIN: ES0341097006)						
Sin ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾						
Vida Media	Años	1,19	-	-	-	-
	Fecha	13/12/2007	-	-	-	-
Amortización Final	Años	2,2	-	-	-	-
	Fecha	15/12/2008	-	-	-	-
Con ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾						
Vida Media	Años	1,19	-	-	-	-
	Fecha	13/12/2007	-	-	-	-
Amortización Final	Años	2,2	-	-	-	-
	Fecha	15/12/2008	-	-	-	-
BONOS SERIE A2 (G) (ISIN: ES0341097014)						
Sin ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾						
Vida Media	Años	5,50	5,33	5,35	5,32	5,34
	Fecha	04/04/2012	02/02/2012	10/02/2012	30/01/2012	30/01/2012
Amortización Final	Años	14,2	13,69	13,69	13,69	13,69
	Fecha	15/12/2020	15/06/2020	15/06/2020	15/06/2020	15/06/2020
Con ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾						
Vida Media	Años	5,21	5,05	5,08	5,04	5,06
	Fecha	20/12/2011	23/10/2011	03/11/2011	19/10/2011	19/10/2011
Amortización Final	Años	8,94	8,69	8,69	8,69	8,69
	Fecha	15/09/2015	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015
BONOS SERIE B (ISIN: ES0341097022)						
Sin ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾						
Vida Media	Años	6,96	6,86	6,94	6,88	6,90
	Fecha	20/09/2013	14/08/2013	12/09/2013	21/08/2013	21/08/2013
Amortización Final	Años	14,44	14,2	13,95	14,2	14,2
	Fecha	15/03/2021	15/12/2020	15/09/2020	15/12/2020	15/12/2020
Con ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾						
Vida Media	Años	5,94	5,85	5,86	5,84	5,85
	Fecha	12/09/2012	10/08/2012	14/08/2012	07/08/2012	07/08/2012
Amortización Final	Años	8,94	8,69	8,69	8,69	8,69
	Fecha	15/09/2015	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015
BONOS SERIE C (ISIN: ES0341097030)						
Sin ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾						
Vida Media	Años	7,17	7,07	7,16	7,05	7,07
	Fecha	05/12/2013	30/10/2013	02/12/2013	23/10/2013	23/10/2013
Amortización Final	Años	16,69	16,19	15,95	16,19	16,19
	Fecha	15/06/2023	15/12/2022	15/09/2022	15/12/2022	15/12/2022
Con ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾						
Vida Media	Años	5,94	5,85	5,86	5,84	5,85
	Fecha	12/09/2012	10/08/2012	14/08/2012	07/08/2012	07/08/2012
Amortización Final	Años	8,94	15,69	8,69	8,69	8,69
	Fecha	15/09/2015	15/06/2022	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015
BONOS SERIE D (ISIN: ES0341097048)						
Sin ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾						
Vida Media	Años	7,93	7,84	7,93	7,82	7,85
	Fecha	09/09/2014	07/08/2014	09/09/2014	31/07/2014	31/07/2014
Amortización Final	Años	29,95	29,95	29,95	29,95	29,95
	Fecha	15/09/2036	15/09/2036	15/09/2036	15/09/2036	15/09/2036
Con ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾						
Vida Media	Años	5,94	5,85	5,86	5,84	5,85
	Fecha	12/09/2012	10/08/2012	14/08/2012	07/08/2012	07/08/2012
Amortización Final	Años	8,94	8,69	8,69	8,69	8,69
	Fecha	15/09/2015	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015
BONOS SERIE E (ISIN: ES0341097055)						
Sin ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾						
Vida Media	Años	4,08	3,96	3,98	3,95	3,96
	Fecha	03/11/2010	20/09/2010	27/09/2010	16/09/2010	16/09/2010
Amortización Final	Años	5,44	5,19	5,44	5,19	5,19
	Fecha	15/03/2012	15/12/2011	15/03/2012	15/12/2011	15/03/2012
Con ejercicio amortización opcional ⁽¹⁾						
Vida Media	Años	6,51	6,33	6,34	6,32	6,33
	Fecha	08/04/2013	02/02/2013	05/02/2013	29/01/2013	29/01/2013
Amortización Final	Años	8,94	8,69	8,69	8,69	8,69
	Fecha	15/09/2015	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015

Hipótesis de morosidad de fallidos de la cartera de Participaciones Hipotecarias: 0% e introducción de una curva de ETT1 (31/08/09)

(1) Amortización a opción de la Sociedad Gestora, cuando el importe del principal pendiente de amortización de las Participaciones

Hipotecarias sea inferior al 10% inicial

Mortgage Securitisation Bonds at 31/08/2009

Estimated Average Life and Final Repayment of Bonds according to quarterly rates of early repayment

RATE OF EARLY REDEMPTION			INITIAL	30/11/2008	28/02/2009	31/05/2009	31/08/2009
% constant monthly			0,340%	0,411%	0,397%	0,419%	0,408%
% constant annual			4,000%	4,825%	4,660%	4,911%	4,789%
CLASS A1 BONDS (ISIN: ES0341097006)							
Without optional repayment ⁽¹⁾							
Average Life	Years		1,19	-	-	-	-
	Date		13/12/2007	-	-	-	-
Final Repayment	Years		2,20	-	-	-	-
	Date		15/12/2008	-	-	-	-
With optional repayment ⁽¹⁾							
Average Life	Years		1,19	-	-	-	-
	Date		13/12/2007	-	-	-	-
Final Repayment	Years		2,20	-	-	-	-
	Date		15/12/2008	-	-	-	-
CLASS A2 (G) BONDS (ISIN: ES0341097014)							
Without optional repayment ⁽¹⁾							
Average Life	Years		5,50	5,33	5,35	5,32	5,34
	Date		04/04/2012	02/02/2012	10/02/2012	30/01/2012	30/01/2012
Final Repayment	Years		14,20	13,69	13,69	13,69	13,69
	Date		15/12/2020	15/06/2020	15/06/2020	15/06/2020	15/06/2020
With optional repayment ⁽¹⁾							
Average Life	Years		5,21	5,05	5,08	5,04	5,06
	Date		20/12/2011	23/10/2011	03/11/2011	19/10/2011	19/10/2011
Final Repayment	Years		8,94	8,69	8,69	8,69	8,69
	Date		15/09/2015	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015
CLASS B BONDS (ISIN: ES0341097022)							
Without optional repayment ⁽¹⁾							
Average Life	Years		6,96	6,86	6,94	6,88	6,90
	Date		20/09/2013	14/08/2013	12/09/2013	21/08/2013	21/08/2013
Final Repayment	Years		14,44	14,2	13,95	14,2	14,2
	Date		15/03/2021	15/12/2020	15/09/2020	15/12/2020	15/12/2020
With optional repayment ⁽¹⁾							
Average Life	Years		5,94	5,85	5,86	5,84	5,85
	Date		12/09/2012	10/08/2012	14/08/2012	07/08/2012	07/08/2012
Final Repayment	Years		8,94	8,69	8,69	8,69	8,69
	Date		15/09/2015	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015
CLASS C BONDS (ISIN: ES0341097030)							
Without optional repayment ⁽¹⁾							
Average Life	Years		7,17	7,07	7,16	7,05	7,07
	Date		05/12/2013	30/10/2013	02/12/2013	23/10/2013	23/10/2013
Final Repayment	Years		16,69	16,19	15,95	16,19	16,19
	Date		15/06/2023	15/12/2022	15/09/2022	15/12/2022	15/12/2022
With optional repayment ⁽¹⁾							
Average Life	Years		5,94	5,85	5,86	5,84	5,85
	Date		12/09/2012	10/08/2012	14/08/2012	07/08/2012	07/08/2012
Final Repayment	Years		8,94	15,69	8,69	8,69	8,69
	Date		15/09/2015	15/06/2022	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015
CLASS D BONDS (ISIN: ES0341097048)							
Without optional repayment ⁽¹⁾							
Average Life	Years		7,93	7,84	7,93	7,82	7,85
	Date		09/09/2014	07/08/2014	09/09/2014	31/07/2014	31/07/2014
Final Repayment	Years		29,95	29,95	29,95	29,95	29,95
	Date		15/09/2036	15/09/2036	15/09/2036	15/09/2036	15/09/2036
With optional repayment ⁽¹⁾							
Average Life	Years		5,94	5,85	5,86	5,84	5,85
	Date		12/09/2012	10/08/2012	14/08/2012	07/08/2012	07/08/2012
Final Repayment	Years		8,94	8,69	8,69	8,69	8,69
	Date		15/09/2015	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015
CLASS E BONDS (ISIN: ES0341097055)							
Without optional repayment ⁽¹⁾							
Average Life	Years		4,08	3,96	3,98	3,95	3,96
	Date		03/11/2010	20/09/2010	27/09/2010	16/09/2010	16/09/2010
Final Repayment	Years		5,44	5,19	5,44	5,19	5,19
	Date		15/03/2012	15/12/2011	15/03/2012	15/12/2011	15/03/2012
With optional repayment ⁽¹⁾							
Average Life	Years		6,51	6,33	6,34	6,32	6,33
	Date		08/04/2013	02/02/2013	05/02/2013	29/01/2013	29/01/2013
Final Repayment	Years		8,94	8,69	8,69	8,69	8,69
	Date		15/09/2015	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015	15/06/2015

Hypotesis of bad defaulter of Participations Portfolio: 0% and ETTI (Interest Rate Temporary Structure) at 31/08/2009

(1) Amortisation at the Gestora's discretion, when principal outstanding balance of Participations is less than 10% of initial amount.

Cartera por índices a 31/08/2009

Situación: Regular
Incluir en WriteOff: No
Cedente: 2013 Caixa d'Estalvis de Catalunya

Índice (1)		Número PH	%	Principal pendiente	%	Tipo nominal	Margen s/ Referencia	Principal/ Tasación	Vida residual		
									Meses	Fecha	
Índice	EICF	Euribor ICF Semestral (día 10)	52	1,752022%	1.583.707,03	0,868592%	1,812936%	0,000000	10,758312	39,839851	26/12/2012
Índice	EM42	Euribor 1 Mes Central Anotac. Bco. España	1	0,033693%	947.326,92	0,519566%	0,983000%	0,500000	47,328841	94,981520	31/07/2017
Índice	ER1A	Euribor 1 año	803	27,055256%	122.238.893,21	67,042542%	4,120378%	0,962150	39,857090	111,753816	24/12/2018
Índice	EU44	Euribor 3 meses Central Anotac. Bco. España	1.076	36,253369%	21.325.927,51	11,696313%	2,246489%	1,266685	0,000000	32,538589	17/05/2012
Índice	EU47	Euribor 6 meses Central Anotac. Bco. España	15	0,505391%	550.645,51	0,302004%	2,245487%	0,796824	0,000000	32,478095	16/05/2012
Índice	EU53	Euribor 12 meses Central Anotac. Bco. España	37	1,246631%	4.756.478,34	2,608715%	4,047244%	0,905157	1,161330	21,542278	18/06/2011
Índice	EU57	Euribor ICO Semestral día 10 - MB5	167	5,626685%	7.315.690,04	4,012327%	2,120885%	0,000000	1,100871	37,470452	15/10/2012
Índice	EU68	Euribor ICO +1 Semestral día 15 - I04	10	0,336927%	140.672,99	0,077153%	2,521128%	0,000000	0,000000	19,444870	15/04/2011
Índice	EU70	Euribor ICO +0,4 Semestral día 15 - I05	110	3,706199%	1.793.685,48	0,983756%	2,036456%	0,000000	1,488528	20,082478	04/05/2011
Índice	EU73	Euribor ICO +0,75 Semestral día 20 - I07	7	0,235849%	133.536,62	0,073239%	2,059393%	0,000000	0,000000	28,567283	18/01/2012
Índice	F000	Tipo Fijo	502	16,913747%	5.916.359,77	3,244858%	4,950033%	0,000000	5,284654	37,918973	28/10/2012
Índice	I13	Euribor ICO - IDAE Semestral día 15	5	0,168464%	901.024,28	0,494171%	2,733404%	0,000000	0,000000	18,744635	25/03/2011
Índice	IRPC	Préstamos Hipotecarios Cajas	6	0,202156%	177.256,75	0,097217%	5,441920%	0,329271	17,611979	55,412783	14/04/2014
Índice	IRPE	Préstamos Hipotecarios Entidades	1	0,033693%	246.577,88	0,135237%	6,580000%	0,500000	17,591138	52,008214	31/12/2013
Índice	MB08	Euribor ICO Semestral día 20 - MB8	6	0,202156%	434.155,40	0,238115%	1,888399%	0,000000	3,128390	9,947380	30/06/2010
Índice	MB09	Euribor ICO Semestral día 20 - MB9	12	0,404313%	59.285,63	0,032516%	1,919768%	0,000000	0,536600	8,524523	17/05/2010
Índice	MB10	Mibor 3 meses Central Anotaciones Bco.Esp.	1	0,033693%	155.143,52	0,085089%	1,900000%	0,500000	0,000000	54,965092	31/03/2014
Índice	MB1A	Mibor 1 Año	3	0,101078%	186.105,71	0,102071%	6,244182%	1,000000	10,211995	62,398588	12/11/2014
Índice	TAE1	Préstamos Hipotecarios Cajas TAE	153	5,154987%	13.465.581,62	7,385267%	5,440072%	0,241695	35,181228	101,790358	23/02/2018
Índice	TAE3	Tipo Activo C.E.C.A TAE	1	0,033693%	2.283,53	0,001252%	6,000000%	1,000000	0,000000	9,954825	30/06/2010
Total	Caixa d´Estalvis de Catalunya		2.968	100%	182.330.337,74	100%	3,870232%	0,842127	40,588785	91,066723	03/04/2017
	Total cartera		2.968	100%	182.330.337,74	100%					
			</								

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

Cartera por índices a 31/08/2009

Situación: Irregular
Incluir en WriteOff: No
Cedente: 2013 Caixa d'Estalvis de Catalunya

Índice (1)			Número PH	%	Principal pendiente	%	Tipo nominal	Margen s/ Referencia	Principal/ Tasación	Vida residual Meses	Fecha
Índice	ER1A	Euribor 1 año	16	10,526316%	1.522.288,39	34,885302%	4,156060%	1,144723	33,608306	97,209022	07/10/2017
Índice	EU44	Euribor 3 meses Central Anotac. Bco. Españ	75	49,342105%	1.373.702,53	31,480256%	2,783006%	1,785529	0,000000	16,379983	12/01/2011
Índice	EU47	Euribor 6 meses Central Anotac. Bco. Españ	3	1,973684%	21.637,88	0,495861%	2,912186%	1,187887	0,000000	12,976202	30/09/2010
Índice	EU53	Euribor 12 meses Central Anotac. Bco. Españ	1	0,657895%	169.183,91	3,877079%	2,933000%	0,900000	0,000000	41,954825	28/02/2013
Índice	EU57	Euribor ICO Semestral día 10 - MB5	7	4,605263%	304.344,44	6,974465%	2,212392%	0,000000	0,000000	23,466609	15/08/2011
Índice	EU70	Euribor ICO +0,4 Semestral día 15 - I05	2	1,315789%	7.507,25	0,172039%	2,219000%	0,000000	0,000000	6,439425	15/03/2010
Índice	F000	Tipo Fijo	40	26,315789%	236.370,52	5,416751%	7,404716%	0,000000	0,000000	13,456098	15/10/2010
Índice	TAE1	Préstamos Hipotecarios Cajas TAE	8	5,263158%	728.660,69	16,698247%	5,768572%	0,414953	38,034626	88,410360	12/01/2017
Total Caixa d'Estalvis de Catalunya			152	100%	4.363.695,61	100%	3,976572%	1,071503	41,085106	57,898700	28/06/2014
Total cartera			152	100%	4.363.695,61	100%					
Media ponderada:							3,976572	1,071503	41,085106	57,898700	28/06/2014
Media simple:							4,572599	1,340132	4,539227	23,500702	16/08/2011
Mínimo:							1,643000	0,000000	0,000000	0,000000	31/12/2008
Máximo:							9,500000	3,000000	60,334905	140,977413	31/05/2021

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

Impagados desde primera cuota vencida a 31/08/2009

Situación: Regular
Incluir en WriteOff: No
Cedente: 2013 Caixa d'Estalvis de Catalunya

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
Caixa d´Estalvis de Catalunya													
Hasta 1 Mes	153	134.236,11	19.849,82	154.085,93	28,19%	7.144.153,58	46,61%	7.278.389,69	46,17%	7.298.239,51	17.763.459,16	30,9305%	31,0266%
De 1 a 2 Meses	66	151.877,65	34.757,45	186.635,10	34,14%	4.439.349,40	28,96%	4.591.227,05	29,13%	4.625.984,50	11.069.224,06	33,4910%	33,7509%
De 2 a 3 Meses	36	99.558,71	42.425,88	141.984,59	25,97%	2.860.558,30	18,66%	2.960.117,01	18,78%	3.002.542,89	6.965.979,85	39,2661%	39,8396%
De 3 a 6 Meses	24	49.888,75	14.030,74	63.919,49	11,69%	883.229,63	5,76%	933.118,38	5,92%	947.149,12	1.367.286,60	51,5557%	52,3852%
Total cedente:	279	435.561,22	111.063,89	546.625,11	100%	15.327.290,91	100%	15.762.852,13	100%	15.873.916,02	37.165.949,67	34,0142%	34,2756%
Total listado:	279	435.561,22	111.063,89	546.625,11	100%	15.327.290,91	100%	15.762.852,13	100%	15.873.916,02	37.165.949,67	34,0142%	34,2756%

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
Caixa d´Estalvis de Catalunya													
De 2 a 3 Meses	1	77,94	0,00	77,94	0,01%	3.684,43	0,08%	3.762,37	0,08%	3.762,37	0,00	0,0000%	0,0000%
De 3 a 6 Meses	49	243.353,42	24.031,70	267.385,12	38,28%	1.307.128,35	29,95%	1.550.481,77	31,16%	1.574.513,47	932.701,24	30,2982%	30,8170%
De 6 a 12 Meses	116	369.152,65	61.814,27	430.966,92	61,71%	3.052.882,83	69,96%	3.422.035,48	68,77%	3.483.849,75	4.679.242,69	36,2870%	36,9480%
Total cedente:	166	612.584,01	85.845,97	698.429,98	100%	4.363.695,61	100%	4.976.279,62	100%	5.062.125,59	5.611.943,93	35,2916%	35,9290%
Total listado:	166	612.584,01	85.845,97	698.429,98	100%	4.363.695,61	100%	4.976.279,62	100%	5.062.125,59	5.611.943,93	35,2916%	35,9290%

Impagados por antigüedad a 31/08/2009

Situación: Regular
 Incluir en WriteOff: No
 Cedente: 2013 Caixa d'Estalvis de Catalunya

Antigüedad de la deuda	Cuotas	Principal	% Principal	Intereses	% Intereses	Comisiones	Demora	Total deuda	% no cobrada
Caixa d'Estalvis de Catalunya									
Hasta 1 Mes	283	257.077,35	59,02%	56.318,68	50,71%	0,00	0,00	313.396,03	57,33%
De 1 a 2 Meses	123	122.031,71	28,02%	33.985,15	30,60%	0,00	0,00	156.016,86	28,54%
De 2 a 3 Meses	59	45.360,10	10,41%	17.318,57	15,59%	0,00	0,00	62.678,67	11,47%
De 3 a 6 Meses	24	11.092,06	2,55%	3.441,49	3,10%	0,00	0,00	14.533,55	2,66%
Total cedente:	489	435.561,22	100,00%	111.063,89	100,00%	0,00	0,00	546.625,11	100,00%
Total listado:	489	435.561,22	100,00%	111.063,89	100,00%	0,00	0,00	546.625,11	100,00%

Impagados por antigüedad a 31/08/2009

Situación: Irregular
Incluir en WriteOff: No
Cedente: 2013 Caixa d'Estalvis de Catalunya

Antigüedad de la deuda	Cuotas	Principal	% Principal	Intereses	% Intereses	Comisiones	Demora	Total deuda	% no cobrada
Caixa d'Estalvis de Catalunya									
Hasta 1 Mes	5	2.512,90	0,41%	171,29	0,20%	0,00	0,00	2.684,19	0,38%
De 1 a 2 Meses	27	52.711,40	8,60%	7.288,62	8,49%	0,00	0,00	60.000,02	8,59%
De 2 a 3 Meses	46	53.888,94	8,80%	3.562,27	4,15%	0,00	0,00	57.451,21	8,23%
De 3 a 6 Meses	226	230.770,96	37,67%	31.627,07	36,84%	0,00	0,00	262.398,03	37,57%
De 6 a 12 Meses	323	272.699,81	44,52%	43.196,72	50,32%	0,00	0,00	315.896,53	45,23%
Total cedente:	627	612.584,01	100,00%	85.845,97	100,00%	0,00	0,00	698.429,98	100,00%
Total listado:	627	612.584,01	100,00%	85.845,97	100,00%	0,00	0,00	698.429,98	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
29/09/2006	440.742.143,72	100,000000%	0,00										
30/09/2006	425.729.070,13	96,593683%	241.948,23	0,05489564%	0,65676241%							0,82027794%	9,41117162%
31/10/2006	417.894.506,22	94,816099%	2.175.007,53	0,51089007%	5,96131526%							0,51419750%	5,99882327%
30/11/2006	409.869.784,19	92,995369%	2.289.860,55	0,54795182%	6,38083132%							0,51817203%	6,04387836%
31/12/2006	400.929.863,31	90,966990%	2.365.568,59	0,57715125%	6,71014177%	0,53768900%	6,26483469%					0,52611147%	6,13382023%
31/01/2007	393.387.964,13	89,255809%	1.875.136,13	0,46769680%	5,47022016%	0,52364748%	6,10591533%					0,50307291%	5,87261010%
28/02/2007	385.487.917,43	87,463367%	2.617.268,91	0,66531494%	7,69801728%	0,56087590%	6,52672004%					0,52342305%	6,10337336%
31/03/2007	375.377.536,00	85,169422%	4.224.758,99	1,09595108%	12,38693925%	0,73006249%	8,41739726%	0,61813974%	7,17061767%			0,59955330%	6,96207127%
30/04/2007	369.111.597,41	83,747743%	926.931,06	0,24693301%	2,92328147%	0,66267662%	7,66859460%	0,57860572%	6,72651748%			0,54566640%	6,35501146%
31/05/2007	361.190.448,64	81,950513%	2.379.475,85	0,64464944%	7,46732434%	0,65551125%	7,58864258%	0,59385737%	6,89807500%			0,54758761%	6,37671711%
30/06/2007	353.960.566,96	80,310125%	1.428.985,97	0,39563227%	4,64563113%	0,42228117%	4,95132294%	0,56720569%	6,59809541%			0,52459276%	6,11662164%
31/07/2007	346.559.539,04	78,630906%	1.835.053,93	0,51843457%	6,04685375%	0,51226826%	5,97694636%	0,57649124%	6,70270992%			0,51586435%	6,01772098%
31/08/2007	338.173.292,87	76,728150%	2.979.486,60	0,85973296%	9,84267612%	0,57955124%	6,73716147%	0,60461801%	7,01894161%			0,53361647%	6,21876789%
30/09/2007	331.392.615,99	75,189682%	1.037.674,03	0,30684683%	3,62065092%	0,55418289%	6,45119446%	0,47570878%	5,56149131%	0,52656271%	6,13892966%	0,51012645%	5,95265349%
31/10/2007	323.437.429,30	73,384729%	2.505.060,12	0,75591911%	8,70323935%	0,63130758%	7,31810591%	0,55702467%	6,48326861%	0,54371856%	6,33300040%	0,51735622%	6,03463193%
30/11/2007	315.830.921,68	71,658889%	2.243.969,53	0,69378783%	8,01500201%	0,57367311%	6,67097120%	0,56298398%	6,55049644%	0,55370466%	6,44579589%	0,51931015%	6,05677638%
31/12/2007	309.111.692,04	70,134362%	1.021.622,03	0,32347119%	3,81333528%	0,58384674%	6,78550351%	0,55491853%	6,45949833%	0,53675899%	6,25431664%	0,50141905%	5,85383318%
31/01/2008	302.809.600,30	68,704481%	849.486,77	0,27481548%	3,24839398%	0,42590976%	4,99287721%	0,51823466%	6,04458817%	0,52431715%	6,11350015%	0,48317574%	5,64648099%
29/02/2008	295.982.185,27	67,155408%	1.548.430,26	0,51135441%	5,96658204%	0,36221438%	4,26101812%	0,45895807%	5,37057781%	0,51090802%	5,96151892%	0,47711888%	5,57754659%
31/03/2008	287.800.201,14	65,298997%	2.182.550,09	0,73739238%	8,49851161%	0,49639877%	5,79681471%	0,52749440%	6,14947866%	0,47716262%	5,57804456%	0,48045166%	5,61548339%
30/04/2008	280.883.704,39	63,729713%	1.647.452,63	0,57242928%	6,65695961%	0,59559918%	6,91764929%	0,49529124%	5,78423154%	0,50266156%	5,86794020%	0,47664108%	5,57210663%
31/05/2008	275.069.458,55	62,410519%	731.358,17	0,26037757%	3,08017128%	0,51635936%	6,02333252%	0,42566298%	4,99005170%	0,47385025%	5,54032650%	0,46196686%	5,40489610%
30/06/2008	269.067.231,90	61,048673%	528.632,81	0,19218157%	2,28195807%	0,33788366%	3,98009699%	0,40786913%	4,78611290%	0,46146091%	5,39912599%	0,44631058%	5,22619584%
31/07/2008	263.027.158,02	59,678241%	1.049.026,30	0,38987516%	4,57947257%	0,27477249%	3,24789354%	0,42766436%	5,01296479%	0,45168896%	5,28761938%	0,43794439%	5,13057762%
31/08/2008	257.609.352,88	58,448995%	606.907,23	0,23073938%	2,73400257%	0,26543298%	3,13910464%	0,38351954%	4,50638728%	0,40186069%	4,71715842%	0,42555220%	4,98878326%
30/09/2008	251.813.922,14	57,134069%	637.945,46	0,24764064%	2,93154489%	0,28498809%	3,36675905%	0,30350501%	3,58187496%	0,39976144%	4,69305611%	0,41452006%	4,86238743%
31/10/2008	244.542.440,19	55,484243%	2.449.591,85	0,97277856%	11,06860138%	0,47040491%	5,50107959%	0,35943912%	4,22901314%	0,40832439%	4,79133573%	0,42249455%	4,95376697%
30/11/2008	239.342.107,07	54,304339%	520.289,40	0,21276037%	2,52345911%	0,46903079%	5,48542241%	0,35408513%	4,16724211%	0,37088709%	4,36097040%	0,41133777%	4,82589918%
31/12/2008	232.350.668,26	52,718051%	2.125.680,28	0,88813469%	10,15212771%	0,67911568%	7,85178381%	0,46304692%	5,41721243%	0,41020757%	4,81293708%	0,41598334%	4,87916115%
31/01/2009	227.263.159,75	51,563746%	418.306,15	0,18003226%	2,13912326%	0,41944523%	4,91883439%	0,43292367%	5,07315268%	0,40652671%	4,77071091%	0,40496406%	4,75277930%
28/02/2009	222.152.479,36	50,404184%	723.329,41	0,31827834%	3,75318561%	0,45712771%	5,34969518%	0,44983265%	5,26642353%	0,39183419%	4,60198973%	0,39736725%	4,66556063%
31/03/2009	216.084.546,45	49,027430%	3.534.870,68	1,59119119%	17,50878524%	0,67544981%	7,81096190%	0,65749146%	7,61074434%	0,44425436%	5,20270323%	0,41413985%	4,85802857%
30/04/2009	207.052.008,02	46,978037%	3.603.209,56	1,66749988%	18,27310948%	1,16661220%	13,13512729%	0,75888748%	8,73600196%	0,51669190%	6,02710198%	0,43066293%	5,04728492%

Tasa de Prepago a 31/08/2009

Incluir en WriteOff: No
Cedente: 2013 Caixa d'Estalvis de Catalunya
Tipo Listado: Por fecha valor
Garantía y tipo interés: {TODOS}

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
31/05/2009	201.727.450,29	45,769948%	1.151.206,91	0,55599891%	6,47169242%	1,25958229%	14,11060936%	0,82143305%	9,42383150%	0,54142998%	6,30713280%	0,42654954%	5,00020220%
30/06/2009	196.557.368,64	44,596908%	867.228,25	0,42990096%	5,03856491%	0,87482927%	10,00727968%	0,75271635%	8,66787759%	0,56503906%	6,57366984%	0,42048057%	4,93069637%
31/07/2009	191.130.035,88	43,365500%	1.298.639,58	0,66069239%	7,64646068%	0,53689374%	6,25584067%	0,83711474%	9,59554034%	0,58687106%	6,81952575%	0,41808092%	4,90320119%
31/08/2009	186.694.033,35	42,359016%	256.679,26	0,13429562%	1,59969722%	0,40191353%	4,71776512%	0,82027835%	9,41117613%	0,58753513%	6,82699467%	0,40809111%	4,78865954%

(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: 15/09/2009 0:00:00

Caixa d'Estalvis de Catalunya**A. FONDOS DISPONIBLES**

Fondos Disponibles por Ingresos - Principal	15.222.902,15 €
Fondos Disponibles por Ingresos - Intereses	2.086.342,66 €
Fondos Disponibles por Ingresos - Demora	35.157,31 €
Fondos Disponibles por Rendimientos de Cuentas	41.516,50 €
Fondos Disponibles F.Reserva	5.549.884,51 €
Fondos Disponibles por Cobro Costas	2.669,56 €
Fondos Disponibles Otros	6,64 €

Total:	22.938.479,33
---------------	----------------------

B. APLICACIÓN DE FONDOS

Impuestos	6,64 €
Gastos Terceros	4.073,69 €
Pago Costas	13.005,68 €
Comisión Agencia Pagos	4.210,21 €
Comisión Sociedad Gestora	10.914,12 €
Pago Cantidad Neta Swap	1.086.636,78 €
Pago Intereses Bonos Serie A2G	588.616,38 €
Pago Intereses Bonos Serie B	19.328,49 €
Pago Intereses Bonos Serie C	49.758,42 €
Pago Intereses Bonos Serie D	65.206,68 €
Fondo Disponible para Amortización	16.117.946,19 €
Dotación Fondo Reserva	4.978.776,05 €

Total:	22.938.479,33
---------------	----------------------

Source and Application of Funds

Payment date: 15/09/2009 0:00:00

Caixa d'Estalvis de Catalunya

A. AVAILABLE AMOUNTS

Available Amounts of the revenues-principal	15.222.902,15 €
Available Amounts of the revenues-interest	2.086.342,66 €
Available Amounts of the revenues-default interest	35.157,31 €
Available Amounts of the income of accounts	41.516,50 €
Available Amounts of the Reserve Fund	5.549.884,51 €
Available Amounts for Costs Payment	2.669,56 €
Other Available Amounts	6,64 €

Total:	22.938.479,33
---------------	----------------------

B. APPLICATION OF FUNDS

Taxes	6,64 €
Expenses	4.073,69 €
Costs Payment	13.005,68 €
Paying agent fee	4.210,21 €
Management fee	10.914,12 €
Payment of Net Amount fo the Swap	1.086.636,78 €
Class A2G bonds interest	588.616,38 €
Class B bonds interest	19.328,49 €
Class C bonds interest	49.758,42 €
Class D bonds interest	65.206,68 €
Available Amounts for Amortisation	16.117.946,19 €
Allocation to the Initial Reserve Fund	4.978.776,05 €

Total:	22.938.479,33
---------------	----------------------