

VAL BANCAJA 1 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Intervalos de Principal / Distribution by Principal Intervals

Activos / Assets: Préstamos hipotecarios vivienda (CTHs) / Residential mortgage loans

Fecha / Date: 31/08/2011

Divisa / Currency: EUR

Intervalos de Principal Principal Intervals		Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance				Principal Vencido Impagado Overdue Principal				Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal			
		Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%
0,00	11.999,99	5	0,27	17.921,56	0,01	0	0,00	0,00	0,00	5	0,27	17.921,56	0,01
12.000,00	23.999,99	18	0,97	318.706,53	0,12	3	2,05	2.741,58	1,57	18	0,97	315.964,95	0,12
24.000,00	35.999,99	36	1,94	1.105.296,49	0,41	3	2,05	535,86	0,31	36	1,94	1.104.760,63	0,41
36.000,00	47.999,99	56	3,02	2.329.745,06	0,86	4	2,74	1.023,64	0,59	56	3,02	2.328.721,42	0,86
48.000,00	59.999,99	77	4,15	4.181.424,67	1,54	4	2,74	1.220,41	0,70	77	4,15	4.180.204,26	1,54
60.000,00	71.999,99	100	5,39	6.657.939,40	2,46	6	4,11	1.237,71	0,71	100	5,39	6.656.701,69	2,46
72.000,00	83.999,99	106	5,71	8.310.178,93	3,07	4	2,74	4.727,83	2,71	106	5,71	8.305.451,10	3,07
84.000,00	95.999,99	117	6,30	10.513.105,40	3,88	9	6,16	3.718,03	2,13	117	6,30	10.509.387,37	3,88
96.000,00	107.999,99	121	6,52	12.331.037,97	4,55	5	3,42	1.089,42	0,62	121	6,52	12.329.948,55	4,55
108.000,00	119.999,99	131	7,05	14.998.386,26	5,53	11	7,53	16.362,17	9,38	131	7,05	14.982.024,09	5,53
120.000,00	131.999,99	146	7,86	18.342.515,26	6,77	10	6,85	6.111,12	3,50	146	7,86	18.336.404,14	6,77
132.000,00	143.999,99	145	7,81	20.019.884,19	7,39	9	6,16	6.173,66	3,54	145	7,81	20.013.710,53	7,39
144.000,00	155.999,99	133	7,16	19.992.632,80	7,38	12	8,22	11.354,65	6,51	133	7,16	19.981.278,15	7,38
156.000,00	167.999,99	105	5,65	16.965.938,98	6,26	9	6,16	4.535,23	2,60	105	5,65	16.961.403,75	6,26
168.000,00	179.999,99	117	6,30	20.324.847,87	7,50	16	10,96	26.267,86	15,06	117	6,30	20.298.580,01	7,49
180.000,00	191.999,99	76	4,09	14.140.559,41	5,22	9	6,16	14.849,88	8,51	76	4,09	14.125.709,53	5,22
192.000,00	203.999,99	69	3,72	13.619.106,12	5,03	5	3,42	3.775,40	2,16	69	3,72	13.615.330,72	5,03
204.000,00	215.999,99	59	3,18	12.397.607,63	4,57	6	4,11	2.370,49	1,36	59	3,18	12.395.237,14	4,58
216.000,00	227.999,99	28	1,51	6.202.480,75	2,29	3	2,05	1.842,26	1,06	28	1,51	6.200.638,49	2,29
228.000,00	239.999,99	45	2,42	10.544.484,54	3,89	2	1,37	11.509,91	6,60	45	2,42	10.532.974,63	3,89
240.000,00	251.999,99	23	1,24	5.642.379,08	2,08	1	0,68	144,80	0,08	23	1,24	5.642.234,28	2,08
252.000,00	263.999,99	18	0,97	4.642.681,56	1,71	0	0,00	0,00	0,00	18	0,97	4.642.681,56	1,71
264.000,00	275.999,99	16	0,86	4.315.320,08	1,59	1	0,68	407,45	0,23	16	0,86	4.314.912,63	1,59
276.000,00	287.999,99	21	1,13	5.913.189,33	2,18	4	2,74	17.021,44	9,76	21	1,13	5.896.167,89	2,18
288.000,00	299.999,99	8	0,43	2.351.073,58	0,87	2	1,37	1.212,69	0,70	8	0,43	2.349.860,89	0,87
300.000,00	311.999,99	12	0,65	3.671.079,38	1,35	2	1,37	4.408,86	2,53	12	0,65	3.666.670,52	1,35
312.000,00	323.999,99	10	0,54	3.185.134,58	1,18	4	2,74	7.244,45	4,15	10	0,54	3.177.890,13	1,17
324.000,00	335.999,99	7	0,38	2.315.357,48	0,85	0	0,00	0,00	0,00	7	0,38	2.315.357,48	0,85

VAL BANCAJA 1 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Intervalos de Principal / Distribution by Principal Intervals

Activos / Assets: Préstamos hipotecarios vivienda (CTHs) / Residential mortgage loans

Fecha / Date: 31/08/2011

Divisa / Currency: EUR

Intervalos de Principal Principal Intervals		Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance				Principal Vencido Impagado Overdue Principal				Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal			
		Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%
336.000,00	347.999,99	4	0,22	1.372.900,75	0,51	0	0,00	0,00	0,00	4	0,22	1.372.900,75	0,51
348.000,00	359.999,99	7	0,38	2.482.530,31	0,92	1	0,68	4.588,43	2,63	7	0,38	2.477.941,88	0,91
360.000,00	371.999,99	2	0,11	740.309,54	0,27	0	0,00	0,00	0,00	2	0,11	740.309,54	0,27
372.000,00	383.999,99	6	0,32	2.258.499,91	0,83	0	0,00	0,00	0,00	6	0,32	2.258.499,91	0,83
384.000,00	395.999,99	2	0,11	778.403,10	0,29	0	0,00	0,00	0,00	2	0,11	778.403,10	0,29
396.000,00	407.999,99	2	0,11	797.827,29	0,29	0	0,00	0,00	0,00	2	0,11	797.827,29	0,29
408.000,00	419.999,99	2	0,11	828.762,81	0,31	0	0,00	0,00	0,00	2	0,11	828.762,81	0,31
420.000,00	431.999,99	1	0,05	431.958,41	0,16	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	431.958,41	0,16
432.000,00	443.999,99	1	0,05	438.835,83	0,16	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	438.835,83	0,16
444.000,00	455.999,99	1	0,05	449.962,42	0,17	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	449.962,42	0,17
456.000,00	467.999,99	1	0,05	458.477,38	0,17	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	458.477,38	0,17
468.000,00	479.999,99	2	0,11	948.615,47	0,35	0	0,00	0,00	0,00	2	0,11	948.615,47	0,35
480.000,00	491.999,99	4	0,22	1.948.126,74	0,72	0	0,00	0,00	0,00	4	0,22	1.948.126,74	0,72
504.000,00	515.999,99	3	0,16	1.530.238,50	0,56	0	0,00	0,00	0,00	3	0,16	1.530.238,50	0,56
528.000,00	539.999,99	1	0,05	539.137,41	0,20	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	539.137,41	0,20
540.000,00	551.999,99	1	0,05	549.304,75	0,20	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	549.304,75	0,20
552.000,00	563.999,99	2	0,11	1.115.523,99	0,41	0	0,00	0,00	0,00	2	0,11	1.115.523,99	0,41
672.000,00	683.999,99	1	0,05	681.567,55	0,25	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	681.567,55	0,25
684.000,00	695.999,99	1	0,05	689.654,35	0,25	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	689.654,35	0,25
708.000,00	719.999,99	1	0,05	717.507,43	0,26	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	717.507,43	0,26
732.000,00	743.999,99	1	0,05	739.978,56	0,27	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	739.978,56	0,27
744.000,00	755.999,99	1	0,05	750.162,09	0,28	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	750.162,09	0,28
816.000,00	827.999,99	1	0,05	817.480,21	0,30	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	817.480,21	0,30
828.000,00	839.999,99	1	0,05	830.943,38	0,31	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	830.943,38	0,31
888.000,00	899.999,99	1	0,05	889.752,03	0,33	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	889.752,03	0,33
936.000,00	947.999,99	2	0,11	1.878.946,49	0,69	1	0,68	17.996,71	10,31	2	0,11	1.860.949,78	0,69

VAL BANCAJA 1 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / *Portfolio of Securitised Assets*

Distribución por Intervalos de Principal / *Distribution by Principal Intervals*

Activos / *Assets*: Préstamos hipotecarios vivienda (CTHs) / *Residential mortgage loans*

Fecha / *Date*: 31/08/2011

Divisa / *Currency*: EUR

Intervalos de Principal <i>Principal Intervals</i>	Saldo Vivo de Principal <i>Outstanding Principal Balance</i>				Principal Vencido Impagado <i>Overdue Principal</i>				Principal Pendiente Vencimiento <i>Outstanding Principal</i>			
	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%
Total :	1.857	100,00	271.015.421,59	100,00	146	100,00	174.471,94	100,00	1.857	100,00	270.840.949,65	100,00
Media Ponderada / <i>Weighted Average</i> :												
Media Simple / <i>Average</i> :			145.942,61				1.195,01				145.848,65	
Mínimo / <i>Minimum</i> :			874,39				0,12				874,39	
Máximo / <i>Maximum</i> :			942.713,17				17.996,71				942.713,17	