

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: 30/09/2011

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	6	0,32	26.294,49	0,01	0	0,00	0,00	0,00	6	0,32	26.294,49	0,01
12.000,00	23.999,99	17	0,92	303.536,19	0,11	2	1,54	255,56	0,14	17	0,92	303.280,63	0,11
24.000,00	35.999,99	37	1,99	1.125.060,98	0,42	1	0,77	458,06	0,25	37	1,99	1.124.602,92	0,42
36.000,00	47.999,99	56	3,02	2.317.482,81	0,86	3	2,31	1.353,98	0,74	56	3,02	2.316.128,83	0,86
48.000,00	59.999,99	79	4,25	4.275.178,71	1,58	3	2,31	1.365,60	0,75	79	4,25	4.273.813,11	1,58
60.000,00	71.999,99	101	5,44	6.708.641,99	2,48	6	4,62	1.890,87	1,03	101	5,44	6.706.751,12	2,48
72.000,00	83.999,99	106	5,71	8.316.299,31	3,08	6	4,62	6.487,82	3,55	106	5,71	8.309.811,49	3,08
84.000,00	95.999,99	119	6,41	10.707.505,37	3,96	7	5,38	3.986,70	2,18	119	6,41	10.703.518,67	3,96
96.000,00	107.999,99	115	6,19	11.725.404,63	4,34	5	3,85	710,18	0,39	115	6,19	11.724.694,45	4,34
108.000,00	119.999,99	135	7,27	15.431.481,16	5,71	11	8,46	17.440,83	9,53	135	7,27	15.414.040,33	5,71
120.000,00	131.999,99	146	7,86	18.346.120,74	6,79	7	5,38	5.529,67	3,02	146	7,86	18.340.591,07	6,79
132.000,00	143.999,99	146	7,86	20.169.910,61	7,47	9	6,92	4.380,56	2,39	146	7,86	20.165.530,05	7,47
144.000,00	155.999,99	132	7,11	19.838.683,92	7,34	10	7,69	11.892,49	6,50	132	7,11	19.826.791,43	7,34
156.000,00	167.999,99	105	5,65	16.957.473,06	6,28	8	6,15	4.326,84	2,37	105	5,65	16.953.146,22	6,28
168.000,00	179.999,99	117	6,30	20.317.046,62	7,52	12	9,23	25.949,38	14,19	117	6,30	20.291.097,24	7,52
180.000,00	191.999,99	79	4,25	14.724.754,65	5,45	4	3,08	12.689,31	6,94	79	4,25	14.712.065,34	5,45
192.000,00	203.999,99	66	3,55	13.053.301,02	4,83	6	4,62	4.546,53	2,49	66	3,55	13.048.754,49	4,83
204.000,00	215.999,99	56	3,02	11.761.522,69	4,35	5	3,85	2.455,33	1,34	56	3,02	11.759.067,36	4,36
216.000,00	227.999,99	28	1,51	6.193.115,22	2,29	3	2,31	2.676,49	1,46	28	1,51	6.190.438,73	2,29
228.000,00	239.999,99	46	2,48	10.779.593,46	3,99	4	3,08	12.933,12	7,07	46	2,48	10.766.660,34	3,99
240.000,00	251.999,99	21	1,13	5.151.426,19	1,91	0	0,00	0,00	0,00	21	1,13	5.151.426,19	1,91
252.000,00	263.999,99	20	1,08	5.162.188,97	1,91	1	0,77	441,84	0,24	20	1,08	5.161.747,13	1,91
264.000,00	275.999,99	15	0,81	4.054.903,72	1,50	1	0,77	408,27	0,22	15	0,81	4.054.495,45	1,50
276.000,00	287.999,99	20	1,08	5.628.071,49	2,08	3	2,31	17.956,43	9,82	20	1,08	5.610.115,06	2,08
288.000,00	299.999,99	8	0,43	2.347.601,32	0,87	2	1,54	2.048,17	1,12	8	0,43	2.345.553,15	0,87
300.000,00	311.999,99	13	0,70	3.974.405,82	1,47	2	1,54	4.335,53	2,37	13	0,70	3.970.070,29	1,47
312.000,00	323.999,99	9	0,48	2.867.747,88	1,06	4	3,08	7.738,24	4,23	9	0,48	2.860.009,64	1,06
324.000,00	335.999,99	7	0,38	2.310.442,21	0,86	0	0,00	0,00	0,00	7	0,38	2.310.442,21	0,86

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: 30/09/2011

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	1.369.686,53	0,51	0	0,00	0,00	0,00	4	0,22	1.369.686,53	0,51
348.000,00	359.999,99	7	0,38	2.478.701,84	0,92	1	0,77	5.033,35	2,75	7	0,38	2.473.668,49	0,92
360.000,00	371.999,99	3	0,16	1.109.601,15	0,41	0	0,00	0,00	0,00	3	0,16	1.109.601,15	0,41
372.000,00	383.999,99	5	0,27	1.878.672,12	0,70	1	0,77	575,62	0,31	5	0,27	1.878.096,50	0,70
384.000,00	395.999,99	2	0,11	776.761,57	0,29	0	0,00	0,00	0,00	2	0,11	776.761,57	0,29
396.000,00	407.999,99	2	0,11	795.895,27	0,29	0	0,00	0,00	0,00	2	0,11	795.895,27	0,29
408.000,00	419.999,99	2	0,11	827.705,87	0,31	0	0,00	0,00	0,00	2	0,11	827.705,87	0,31
420.000,00	431.999,99	1	0,05	431.958,41	0,16	1	0,77	601,77	0,33	1	0,05	431.356,64	0,16
432.000,00	443.999,99	1	0,05	438.059,56	0,16	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	438.059,56	0,16
444.000,00	455.999,99	1	0,05	449.078,23	0,17	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	449.078,23	0,17
456.000,00	467.999,99	1	0,05	457.187,56	0,17	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	457.187,56	0,17
468.000,00	479.999,99	3	0,16	1.422.066,51	0,53	0	0,00	0,00	0,00	3	0,16	1.422.066,51	0,53
480.000,00	491.999,99	3	0,16	1.453.769,71	0,54	0	0,00	0,00	0,00	3	0,16	1.453.769,71	0,54
504.000,00	515.999,99	3	0,16	1.527.370,60	0,57	0	0,00	0,00	0,00	3	0,16	1.527.370,60	0,57
528.000,00	539.999,99	1	0,05	538.090,63	0,20	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	538.090,63	0,20
540.000,00	551.999,99	1	0,05	548.221,97	0,20	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	548.221,97	0,20
552.000,00	563.999,99	2	0,11	1.112.994,80	0,41	0	0,00	0,00	0,00	2	0,11	1.112.994,80	0,41
672.000,00	683.999,99	1	0,05	679.195,69	0,25	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	679.195,69	0,25
684.000,00	695.999,99	1	0,05	687.042,71	0,25	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	687.042,71	0,25
708.000,00	719.999,99	1	0,05	717.507,43	0,27	1	0,77	2.201,78	1,20	1	0,05	715.305,65	0,26
732.000,00	743.999,99	1	0,05	736.219,23	0,27	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	736.219,23	0,27
744.000,00	755.999,99	1	0,05	749.059,64	0,28	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	749.059,64	0,28
804.000,00	815.999,99	1	0,05	815.452,23	0,30	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	815.452,23	0,30
828.000,00	839.999,99	1	0,05	829.752,13	0,31	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	829.752,13	0,31
876.000,00	887.999,99	1	0,05	887.716,69	0,33	0	0,00	0,00	0,00	1	0,05	887.716,69	0,33
936.000,00	947.999,99	2	0,11	1.877.445,12	0,69	1	0,77	20.263,16	11,08	2	0,11	1.857.181,96	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*: 30/09/2011

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	270.170.408,43	100,00	130	100,00	182.933,48	100,00	1.857	100,00	269.987.474,95	100,00
Media Ponderada / <i>Weighted Average</i> :												
Media Simple / <i>Average</i> :			145.487,57				1.407,18				145.389,05	
Mínimo / <i>Minimum</i> :			656,26				0,09				656,26	
Máximo / <i>Maximum</i> :			941.211,80				20.263,16				941.211,80	