

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: 31/08/2012

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	10	0,55	62.980,43	0,02	1	0,56	29,22	0,00	10	0,55	62.951,21	0,02
12.000,00	23.999,99	25	1,37	477.018,10	0,19	1	0,56	27,90	0,00	25	1,38	476.990,20	0,19
24.000,00	35.999,99	39	2,14	1.209.752,50	0,47	5	2,78	36.787,85	5,67	38	2,09	1.172.964,65	0,46
36.000,00	47.999,99	62	3,41	2.604.026,72	1,01	6	3,33	2.229,57	0,34	62	3,42	2.601.797,15	1,02
48.000,00	59.999,99	86	4,73	4.713.066,29	1,84	8	4,44	60.389,85	9,30	85	4,68	4.652.676,44	1,82
60.000,00	71.999,99	101	5,55	6.646.788,72	2,59	11	6,11	5.662,32	0,87	101	5,56	6.641.126,40	2,59
72.000,00	83.999,99	104	5,72	8.110.517,71	3,16	10	5,56	14.237,01	2,19	104	5,73	8.096.280,70	3,16
84.000,00	95.999,99	122	6,71	10.996.371,53	4,28	9	5,00	9.998,62	1,54	122	6,72	10.986.372,91	4,29
96.000,00	107.999,99	111	6,10	11.352.569,63	4,42	6	3,33	2.547,72	0,39	111	6,12	11.350.021,91	4,43
108.000,00	119.999,99	146	8,03	16.688.134,81	6,50	14	7,78	144.260,89	22,22	145	7,99	16.543.873,92	6,46
120.000,00	131.999,99	136	7,48	17.132.895,90	6,68	10	5,56	7.769,70	1,20	136	7,49	17.125.126,20	6,69
132.000,00	143.999,99	147	8,08	20.257.820,95	7,89	14	7,78	150.116,60	23,12	146	8,04	20.107.704,35	7,85
144.000,00	155.999,99	127	6,98	19.104.891,72	7,44	12	6,67	18.798,68	2,90	127	7,00	19.086.093,04	7,45
156.000,00	167.999,99	97	5,33	15.729.802,40	6,13	11	6,11	8.670,84	1,34	97	5,34	15.721.131,56	6,14
168.000,00	179.999,99	97	5,33	16.800.403,44	6,55	14	7,78	31.493,23	4,85	97	5,34	16.768.910,21	6,55
180.000,00	191.999,99	79	4,34	14.684.342,62	5,72	5	2,78	2.283,56	0,35	79	4,35	14.682.059,06	5,73
192.000,00	203.999,99	68	3,74	13.452.420,50	5,24	7	3,89	12.138,75	1,87	68	3,75	13.440.281,75	5,25
204.000,00	215.999,99	43	2,36	9.015.217,31	3,51	5	2,78	5.791,01	0,89	43	2,37	9.009.426,30	3,52
216.000,00	227.999,99	31	1,70	6.905.982,80	2,69	4	2,22	3.308,43	0,51	31	1,71	6.902.674,37	2,70
228.000,00	239.999,99	38	2,09	8.872.581,44	3,46	7	3,89	28.405,96	4,38	38	2,09	8.844.175,48	3,45
240.000,00	251.999,99	21	1,15	5.147.088,85	2,01	1	0,56	0,02	0,00	21	1,16	5.147.088,83	2,01
252.000,00	263.999,99	18	0,99	4.638.046,00	1,81	0	0,00	0,00	0,00	18	0,99	4.638.046,00	1,81
264.000,00	275.999,99	14	0,77	3.788.054,46	1,48	4	2,22	3.262,09	0,50	14	0,77	3.784.792,37	1,48
276.000,00	287.999,99	16	0,88	4.490.612,85	1,75	3	1,67	5.403,36	0,83	16	0,88	4.485.209,49	1,75
288.000,00	299.999,99	12	0,66	3.524.962,29	1,37	1	0,56	5.520,87	0,85	12	0,66	3.519.441,42	1,37
300.000,00	311.999,99	7	0,38	2.140.646,45	0,83	0	0,00	0,00	0,00	7	0,39	2.140.646,45	0,84
312.000,00	323.999,99	10	0,55	3.173.088,67	1,24	3	1,67	2.026,87	0,31	10	0,55	3.171.061,80	1,24
324.000,00	335.999,99	5	0,27	1.647.941,65	0,64	0	0,00	0,00	0,00	5	0,28	1.647.941,65	0,64

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: 31/08/2012

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	2	0,11	683.053,98	0,27	0	0,00	0,00	0,00	2	0,11	683.053,98	0,27
348.000,00	359.999,99	7	0,38	2.479.591,01	0,97	1	0,56	4.583,18	0,71	7	0,39	2.475.007,83	0,97
360.000,00	371.999,99	4	0,22	1.469.989,45	0,57	1	0,56	6.726,34	1,04	4	0,22	1.463.263,11	0,57
372.000,00	383.999,99	4	0,22	1.514.667,82	0,59	0	0,00	0,00	0,00	4	0,22	1.514.667,82	0,59
384.000,00	395.999,99	1	0,05	393.840,60	0,15	1	0,56	543,29	0,08	1	0,06	393.297,31	0,15
396.000,00	407.999,99	2	0,11	802.570,46	0,31	0	0,00	0,00	0,00	2	0,11	802.570,46	0,31
420.000,00	431.999,99	2	0,11	854.263,05	0,33	1	0,56	4,90	0,00	2	0,11	854.258,15	0,33
432.000,00	443.999,99	3	0,16	1.318.841,19	0,51	0	0,00	0,00	0,00	3	0,17	1.318.841,19	0,52
456.000,00	467.999,99	3	0,16	1.385.256,73	0,54	1	0,56	5.087,78	0,78	3	0,17	1.380.168,95	0,54
468.000,00	479.999,99	2	0,11	955.432,97	0,37	0	0,00	0,00	0,00	2	0,11	955.432,97	0,37
492.000,00	503.999,99	3	0,16	1.496.644,61	0,58	0	0,00	0,00	0,00	3	0,17	1.496.644,61	0,58
516.000,00	527.999,99	1	0,05	526.142,28	0,20	0	0,00	0,00	0,00	1	0,06	526.142,28	0,21
528.000,00	539.999,99	2	0,11	1.076.430,14	0,42	0	0,00	0,00	0,00	2	0,11	1.076.430,14	0,42
540.000,00	551.999,99	1	0,05	546.204,51	0,21	0	0,00	0,00	0,00	1	0,06	546.204,51	0,21
648.000,00	659.999,99	2	0,11	1.310.919,28	0,51	1	0,56	698,84	0,11	2	0,11	1.310.220,44	0,51
684.000,00	695.999,99	1	0,05	694.255,19	0,27	0	0,00	0,00	0,00	1	0,06	694.255,19	0,27
708.000,00	719.999,99	1	0,05	717.507,43	0,28	1	0,56	27.107,42	4,18	1	0,06	690.400,01	0,27
732.000,00	743.999,99	1	0,05	737.003,81	0,29	0	0,00	0,00	0,00	1	0,06	737.003,81	0,29
792.000,00	803.999,99	1	0,05	792.615,39	0,31	0	0,00	0,00	0,00	1	0,06	792.615,39	0,31
816.000,00	827.999,99	1	0,05	818.571,18	0,32	0	0,00	0,00	0,00	1	0,06	818.571,18	0,32
864.000,00	875.999,99	1	0,05	865.910,15	0,34	0	0,00	0,00	0,00	1	0,06	865.910,15	0,34
924.000,00	935.999,99	1	0,05	924.940,76	0,36	0	0,00	0,00	0,00	1	0,06	924.940,76	0,36
936.000,00	947.999,99	1	0,05	936.233,32	0,36	1	0,56	43.280,22	6,67	1	0,06	892.953,10	0,35
Total :		1.819	100,00	256.668.912,05	100,00	180	100,00	649.192,89	100,00	1.815	100,00	256.019.719,16	100,00
Media Ponderada / Weighted Average :													
Media Simple / Average :		141.104,40				3.606,63				141.057,70			
Mínimo / Minimum :		1.444,76				0,02				1.444,76			
Máximo / Maximum :		936.233,32				137.112,58				924.940,76			