

VAL BANCAJA 1 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Intervalos de Fecha de Vencimiento Final / Distribution by Final Maturity Date Intervals

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

Fecha / Date: 31/08/2011

Divisa / Currency: EUR

Intervalos anuales Annual Intervals	Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance				Principal Vencido Impagado Overdue Principal				Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal				Tipo Interés Interest Rate	Vida residual Residual Life
	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Media Pond. W. Average	M. Pond. Meses W. Avg. Months
2011	2	0,11	2.451,57	0,00	0	0,00	0,00	0,00	2	0,11	2.451,57	0,00	1,741%	3,357
2012	1	0,05	12.385,21	0,00	1	0,68	2.408,58	1,38	1	0,05	9.976,63	0,00	2,904%	11,032
2013	2	0,11	34.304,95	0,01	0	0,00	0,00	0,00	2	0,11	34.304,95	0,01	2,752%	24,495
2014	4	0,22	232.699,56	0,09	0	0,00	0,00	0,00	4	0,22	232.699,56	0,09	2,339%	32,589
2015	8	0,43	252.805,46	0,09	0	0,00	0,00	0,00	8	0,43	252.805,46	0,09	2,367%	45,952
2016	5	0,27	180.352,68	0,07	1	0,68	302,06	0,17	5	0,27	180.050,62	0,07	2,482%	57,027
2017	7	0,38	252.399,99	0,09	0	0,00	0,00	0,00	7	0,38	252.399,99	0,09	2,599%	73,559
2018	11	0,59	635.302,85	0,23	0	0,00	0,00	0,00	11	0,59	635.302,85	0,23	2,389%	83,466
2019	6	0,32	315.333,39	0,12	0	0,00	0,00	0,00	6	0,32	315.333,39	0,12	2,395%	94,291
2020	10	0,54	990.115,56	0,37	1	0,68	19,92	0,01	10	0,54	990.095,64	0,37	2,636%	106,424
2021	11	0,59	966.207,08	0,36	2	1,37	2.935,75	1,68	11	0,59	963.271,33	0,36	2,474%	118,204
2022	13	0,70	1.217.356,45	0,45	1	0,68	10.836,41	6,21	13	0,70	1.206.520,04	0,45	2,447%	130,206
2023	38	2,05	2.734.115,21	1,01	4	2,74	2.017,91	1,16	38	2,05	2.732.097,30	1,01	2,502%	142,540
2024	15	0,81	1.093.543,75	0,40	0	0,00	0,00	0,00	15	0,81	1.093.543,75	0,40	2,347%	154,539
2025	18	0,97	2.123.921,68	0,78	0	0,00	0,00	0,00	18	0,97	2.123.921,68	0,78	2,498%	164,900
2026	14	0,75	1.409.328,62	0,52	1	0,68	1.915,67	1,10	14	0,75	1.407.412,95	0,52	2,608%	176,871
2027	28	1,51	4.346.665,36	1,60	3	2,05	7.249,46	4,16	28	1,51	4.339.415,90	1,60	2,687%	191,490
2028	75	4,04	7.901.414,56	2,92	5	3,42	20.485,06	11,74	75	4,04	7.880.929,50	2,91	2,385%	202,016
2029	24	1,29	3.010.586,63	1,11	3	2,05	456,11	0,26	24	1,29	3.010.130,52	1,11	2,404%	214,691
2030	26	1,40	3.409.839,44	1,26	0	0,00	0,00	0,00	26	1,40	3.409.839,44	1,26	2,607%	227,157
2031	38	2,05	5.691.334,91	2,10	6	4,11	22.805,68	13,07	38	2,05	5.668.529,23	2,09	2,615%	237,299
2032	37	1,99	4.151.029,43	1,53	4	2,74	2.095,73	1,20	37	1,99	4.148.933,70	1,53	2,344%	250,605
2033	113	6,09	13.448.010,06	4,96	3	2,05	676,71	0,39	113	6,09	13.447.333,35	4,97	2,424%	262,265
2034	21	1,13	2.865.001,16	1,06	2	1,37	1.410,16	0,81	21	1,13	2.863.591,00	1,06	2,495%	274,806
2035	37	1,99	5.664.453,54	2,09	4	2,74	1.962,45	1,12	37	1,99	5.662.491,09	2,09	2,440%	286,892
2036	48	2,58	7.864.311,46	2,90	4	2,74	12.545,76	7,19	48	2,58	7.851.765,70	2,90	2,362%	296,688
2037	44	2,37	7.639.149,19	2,82	8	5,48	30.081,36	17,24	44	2,37	7.609.067,83	2,81	2,350%	310,996
2038	221	11,90	31.104.503,35	11,48	13	8,90	5.669,72	3,25	221	11,90	31.098.833,63	11,48	2,366%	322,245
2039	6	0,32	895.732,10	0,33	1	0,68	572,43	0,33	6	0,32	895.159,67	0,33	2,450%	335,835
2040	36	1,94	6.370.497,79	2,35	1	0,68	582,53	0,33	36	1,94	6.369.915,26	2,35	2,546%	347,293

Medias ponderadas por el principal pendiente de vencimiento / Averages weighted by the outstanding principal.

Tipo Interés: Tipo de interés nominal anual / Interest Rate: Annual nominal interest rate.

VAL BANCAJA 1 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Intervalos de Fecha de Vencimiento Final / Distribution by Final Maturity Date Intervals

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

Fecha / Date: 31/08/2011

Divisa / Currency: EUR

Intervalos anuales Annual Intervals	Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance				Principal Vencido Impagado Overdue Principal				Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal				Tipo Interés Interest Rate	Vida residual Residual Life
	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Media Pond. W. Average	M. Pond. Meses W. Avg. Months
2041	82	4,42	14.195.441,68	5,24	18	12,33	17.741,64	10,17	82	4,42	14.177.700,04	5,23	2,515%	356,328
2042	38	2,05	6.171.475,17	2,28	4	2,74	3.731,97	2,14	38	2,05	6.167.743,20	2,28	2,400%	370,313
2043	140	7,54	20.561.946,82	7,59	9	6,16	4.070,24	2,33	140	7,54	20.557.876,58	7,59	2,342%	382,257
2044	14	0,75	2.024.802,21	0,75	4	2,74	866,25	0,50	14	0,75	2.023.935,96	0,75	2,508%	395,136
2045	19	1,02	2.997.823,50	1,11	0	0,00	0,00	0,00	19	1,02	2.997.823,50	1,11	2,450%	405,547
2046	45	2,42	8.105.521,21	2,99	4	2,74	1.554,37	0,89	45	2,42	8.103.966,84	2,99	2,444%	419,092
2047	106	5,71	19.646.328,88	7,25	8	5,48	4.125,45	2,36	106	5,71	19.642.203,43	7,25	2,472%	430,076
2048	494	26,60	80.496.929,13	29,70	31	21,23	15.352,56	8,80	494	26,60	80.481.576,57	29,72	2,422%	442,278
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 / Weighted Average :													2,431%	353,388
Media Simple / Average :			145.942,61				1.195,01				145.848,65		2,439%	335,380
Mínimo / Minimum :			874,39				0,12				874,39		1,266%	30/11/2011
Máximo / Maximum :			942.713,17				17.996,71				942.713,17		3,897%	11/10/2048