

Importes expresados en euros

Fecha Constitución	09/03/2007
Fecha Emisión Bonos	09/03/2007
Fecha Desembolso	15/03/2007
Sociedad Gestora	Gestión de Activos Titulizados, SGFT, SA
Administrador	CatalunyaCaixa
Cta. Tesorería a Tipo Garantizado	Barclays
Permutas Intereses	CECABANK
Prestamo Subordinado	CatalunyaCaixa
Directores	CatalunyaCaixa, JP Morgan, Natixis, UBS Investment Bank

Directores Aseguramiento	CatalunyaCaixa, JP Morgan, Natixis, UBS Investment Bank
Originador	CatalunyaCaixa
Agente de Pagos	Barclays
Mercado Negociación	AIAF
Reg. Contable Valores	Iberclear
Depositario Participaciones	CatalunyaCaixa
Auditores	Deloitte & Touche
Depósito garantía/liquidez	
Línea liquidez/crédito	

VALORES EMITIDOS: BONOS DE TITULIZACIÓN HIPOTECARIA (ESTRUCTURA PREFERENTE/SUBORDINADA)

Serie Código ISIN Prelación/Tipo Amortización	Nominal Circulación (Unitario/Total)			Clase Intereses Frecuencia	Tipo Interés Actual Periodo Devengado: 92 días Base: A/ 360	Amortización		Moody's / S&P / Fitch Ibca / DBRS	
	Factor Actual	Actual	Inicial			Final Frecuencia	Próxima	Actual	Inicial
SERIE A1 ES0345672002 Preferente / Pass-Through	- %	0,00€ 2.000	100.000,00€ 2.000	Variable EURIB.3M+0,04%	- % Fecha: 15-10-2015	17-01-2050		Aaa AAA	Aaa AAA
		0,00€	200.000.000,00€	15-1/4/7/10	Intereses: -		15-1/4/7/10	AAA	AAA
SERIE A2 ES0345672010 Preferente / Pass-Through	32,01%	32.010,23€ 10.832	100.000,00€ 10.832	Variable EURIB.3M+0,13%	0,111% Fecha: 15-10-2015	17-01-2050		B2 CCC	Aaa AAA
		346.734.811,36€	1.083.200.000,00€	15-1/4/7/10	Intereses: 9,08 €		15-1/4/7/10	B	AAA
SERIE A3 ES0345672028 Preferente / Pass-Through	53,88%	53.875,63€ 2.000	100.000,00€ 2.000	Variable EURIB.3M+0,16%	0,141% Fecha: 15-10-2015	17-01-2050		B2 CCC	Aaa AAA
		107.751.260,00€	200.000.000,00€	15-1/4/7/10	Intereses: 19,41 €		15-1/4/7/10	B	AAA
SERIE B ES0345672036 Mezzanine / Pass-Through	100,00%	100.000,00€ 528	100.000,00€ 528	Variable EURIB.3M+0,26%	0,241% Fecha: 15-10-2015	17-01-2050		C D	Aa2 A
		52.800.000,00€	52.800.000,00€	15-1/4/7/10	Intereses: 61,59 €		15-1/4/7/10	CC	A+
SERIE C ES0345672044 Subordinada / Pass-Through	100,00%	100.000,00€ 640	100.000,00€ 640	Variable EURIB.3M+0,50%	0,481% Fecha: 15-10-2015	17-01-2050		C D	Baa2 BBB
		64.000.000,00€	64.000.000,00€	15-1/4/7/10	Intereses: 122,92 €		15-1/4/7/10	CC	BBB
SERIE D ES0345672051 Equity / Por reducción Fondo Reserva	100,00%	100.000,00€ 280	100.000,00€ 280	Variable EURIB.3M+4,50%	4,481% Fecha: 15-10-2015	17-01-2050		C D	Caa3 CCC-
		28.000.000,00€	28.000.000,00€	15-1/4/7/10	Intereses: 1145,14 €		15-1/4/7/10	C	CCC
Totales		599.286.071,36 €	1.628.000.000,00 €						

ACTIVO AGRUPADO: TIPO DE ACTIVO AGRUPADO

General	Actual	Fecha de Constitución
Principal		
Número	4.359	10.635
Saldo Vivo	432.121.420,83€	1.600.000.049,35€
Medio	98.664,09€	150.434,99€
Mínimo	238,95€	15.043,34€
Máximo	921.404,75€	1.562.669,08€
Interés		
Medio Ponderado	1,7539%	4,4261%
Mínimo	0,4980%	2,8500%
Máximo	4,4440%	5,7500%
Vida Residual (Meses)		
Medio Ponderado	238,29	335,38
Mínimo	0,99	16,79
Máximo	376,02	477,80
Índice de referencia (Distib. en porcentaje sobre total de ppal PDTE)		
Euribor 1 año	66,48%	52,58%
Mibor 1 Año	0,14%	0,12%
Préstamos Hipotecarios Cajas	0,00%	0,19%
Préstamos Hipotecarios Cajas TAE	0,00%	47,08%
Préstamos Hipotecarios Entidades	33,38%	0,00%
Tipo Activo C.E.C.A TAE	0,00%	0,01%
Tipo Activo CECA	0,00%	0,02%

AMORTIZACION ANTICIPADA

	Último mes	Últimos 3 meses	Últimos 6 meses	Últimos 12 meses	Histórica
Tasa Mensual Equivalente	0,1501%	0,4994%	0,5405%	0,5556%	0,6328%
Tasa Anual Equivalente	1,7862%	5,8313%	6,2968%	6,4670%	7,3345%

DISTRIBUCIÓN GEOGRÁFICA

	Actual	Fecha Constitución
Catalunya	69,99	70,19
Madrid	11,87	12,33
Comunidad Valenciana	7,70	7,62
Baleares	0,67	0,43
Aragón	0,72	1,25
Andalucía	2,41	1,89
Murcia	1,59	2,34
Navarra	0,67	0,82
Otras comunidades	4,38	3,13

IMPAGADOS (< 3 MESES)

Antigüedad	Número Participaciones Préstamos	Deuda Vencida			Deuda Pendiente Vencimiento	Deuda Total		% Deuda Total / Valor Tasación (1)
		Principal	Intereses y Otros	Total		Principal	%	
Hasta 1 Mes	87	25.684,84 €	5.461,17 €	31.146,01 €	10.782.872,72 €	10.808.557,56 €	55,38%	9,5539%
De 1 a 2 Meses	42	34.353,99 €	10.456,02 €	44.810,01 €	5.494.204,14 €	5.528.558,13 €	28,32%	68,5320%
De 2 a 3 Meses	29	34.722,96 €	11.121,56 €	45.844,52 €	3.146.937,47 €	3.181.660,43 €	16,30%	60,1493%
Totales	158	94.761,79 €	27.038,75 €	121.800,54 €	19.424.014,33 €	19.518.776,12 €	100,00%	15,4415%

(1) Tasación solo en Préstamos Hipotecarios

DUDOSOS Y SUBJETIVOS

Antigüedad	Número Participaciones Préstamos	Deuda Vencida			Deuda Pendiente Vencimiento	Deuda Total		% Deuda Total / Valor Tasación (1)
		Principal	Intereses y Otros	Total		Principal	%	
Hasta 1 Mes	44	532,13 €	0,00 €	532,13 €	5.933.527,50 €	5.934.059,63 €	15,01%	94,4214%
De 1 a 2 Meses	4	443,92 €	0,00 €	443,92 €	629.074,94 €	629.518,86 €	1,59%	127,6210%
De 2 a 3 Meses	4	208,81 €	108,01 €	316,82 €	262.815,66 €	263.024,47 €	0,67%	85,8787%
De 3 a 6 Meses	56	83.664,05 €	31.874,41 €	115.538,46 €	6.539.535,84 €	6.623.199,89 €	16,75%	69,9417%
De 6 a 12 Meses	89	126.785,81 €	68.806,80 €	195.592,61 €	12.807.162,90 €	12.933.948,71 €	32,72%	84,6170%
De 12 a 18 Meses	90	118.466,28 €	75.564,08 €	194.030,36 €	13.031.674,11 €	13.150.140,39 €	33,26%	116,8755%
Totales	287	330.101,00 €	176.353,30 €	506.454,30 €	39.203.790,95 €	39.533.891,95 €	100,00%	91,7474%

(1) Tasación solo en Préstamos Hipotecarios

MEJORA CREDITICIA

Descripción	Actual			A la emisión		
	% Bonos	Nominal	% MC	% Bonos	Nominal	% MC
SERIE A1	0,00%	0,00€	0,00%	12,29%	200.000.000,00€	9,05%
SERIE A2	57,86%	346.734.811,36€	20,45%	66,54%	1.083.200.000,00€	9,05%
SERIE A3	17,98%	107.751.260,00€	20,45%	12,29%	200.000.000,00€	9,05%
SERIE B	8,81%	52.800.000,00€	11,20%	3,24%	52.800.000,00€	5,75%
SERIE C	10,68%	64.000.000,00€	0,00%	3,93%	64.000.000,00€	1,75%
SERIE D	4,67%	28.000.000,00€	0,00%	1,72%	28.000.000,00€	0,00%
Total		599.286.071,36 €			1.628.000.000,00 €	
Fondo de Reserva Teórico		28.000.000,00€	4,90%		28.000.000,00€	1,75%
Fondo de Reserva Dotado		118,91€	0,00%		28.000.000,00€	1,75%

OTRAS OPERACIONES FINANCIERAS (Actual)

	Saldo	Interés
Activo		
CUENTA DE TESORERÍA	5.648.783,08 €	0,00%
CUENTA AGENTE DE PAGOS	0,00 €	0,00%
CUENTA TESORERÍA - AMORTIZACIÓN	0,00 €	0,00%
CUENTA RETENCIÓN DE PRINCIPALES	0,00 €	0,00%
CTA. TESOR. - COLATERIZACION SWAP	0,00 €	0,00%
LÍM. DISP. LÍNEA LIQUIDEZ/CRÉDITO	0,00 €	0,00%
DEPÓSITO LIQUIDEZ	0,00 €	
DEPÓSITO GARANTÍA	0,00 €	
Pasivo		
PRÉSTAMO SUBORDINADO	0,00 €	0,00%
PRÉSTAMO GASTOS INICIALES	334.503,24 €	0,00%
IMPORTE DISPUESTO POR LÍNEA DE LIQUIDEZ/CRÉDITO	0,00 €	0,00%
Préstamo B	0,00 €	0,00%

OTRA INFORMACIÓN

	Acumulado	Período
Pérdidas Consolidadas acumuladas de la cartera		
Condonaciones de principal, costas e intereses y pérdidas por adjudicación y venta de fincas.	56.043.235,67 €	315.274,84 €
Write-Off acumulados		
Importe de los préstamos fallidos acumulados definidos como operaciones con una morosidad superior a 18 meses, o considerados como tal por el cedente.	368.262.113,21 €	2.065.207,49 €
Recuperaciones sobre Write-Off acumulados		
Recuperaciones de principal y recuperaciones por la venta de fincas adjudicadas.	175.273.646,54 €	-384.986,73 €
	Actual	A la emisión
Déficit amortización o dotación de bonos	131.669.270,08 €	0,00 €
Ratio de morosidad		
Saldo Vivo Impagados > 90 días / Saldo Vivo Total	7,5690%	0,0000%
Media Ponderada Principal / Valor Tasación		
Tasación solo en Préstamos Hipotecarios	67,3725%	81,6581%

INFORMACIÓN PERIODO EN ESPERA

Saldo Vivo Ph's periodo en espera	4.295.735,55 €
Intereses Devengados	55.310,14 €
Ratio: (Saldo vivo GE + Intereses Devengados) / Saldo Vivo Total	1,0069%

PERMUTAS INTERÉS (Swap)

	Principal Ncional	Interés
Swap		
Receptor	A Determinar	0,820124%
Pagador	A Determinar	A Determinar

Informe Mensual, Agosto 2015

HIPOCAT 11 FTA Fondo de Titulización de Activos



SITUACIÓN CARTERA

Cartera Viva Actual	432.121.420,83 €
Saldo Vivo al Corriente de Pago	373.068.752,76 €
Saldo Vivo Impagados (< 3 meses)	19.518.776,12 €
Saldo Vivo Dudosos y subjetivos	39.533.891,95 €
Cartera Amortizada	1.045.247.196,37 €
Principal Cobrado desde la Constitución	1.065.839.194,89 €
Capitalización Intereses Garantía en Espera	-20.591.998,52 €
Principal Actual de Fallidos	122.631.432,15 €
Número de préstamos en Fallido	1.387
Total Titulizado	1.600.000.049,35 €

INFORMACIÓN ADICIONAL EN:

Sociedad Gestora: Gestión de Activos Titulizados, SGFT, S.A.

Registro Oficial: Comisión Nacional del Mercado de Valores

Polígon Mas Mateu, Roure, 6-8 08820 El Prat de Llobregat Tel. 93 484 73 36 - FAX: 93 484 73 41

info@gat-sgft.com www.gat-sgft.info

Passeig de Gràcia 16, Barcelona

RESPONSABILIDAD CONTENIDO INFORMACIÓN:

Gestión de Activos Titulizados, SGFT, S.A.

EL DIRECTOR EJECUTIVO