

VAL BANCAJA 1 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Indices de Referencia / Distribution by Reference Indexes

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

Fecha / Date: 31/08/2011

Divisa / Currency: EUR

Indices de Referencia Reference Indexes	Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance				Principal Vencido Impagado Overdue Principal				Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal				Tipo Int. Int. Rate	Margen s/Indice Margin o/Index		
	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Med.Pond. W. Avg.	M.Pond. W. Avg.	Min.	Max.
Interés Variable Floating Interest	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	2,431%			
EURIBOR/MIBOR a 3 meses 3-month EURIBOR/MIBOR	31	1,67	3.430.716,82	1,27	3	2,05	870,02	0,50	31	1,67	3.429.846,80	1,27	2,108%	0,782	0,250	1,500
EURIBOR/MIBOR a 1 año (M. Hipotecario) 1-year EURIBOR/MIBOR (Mortgage Market)	1.826	98,33	267.584.704,77	98,73	143	97,95	173.601,92	99,50	1.826	98,33	267.411.102,85	98,73	2,435%	0,731	0,250	2,000
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%			
Media Simple / Average :			145.942,61				1.195,01				145.848,65		2,439%			
Mínimo / Minimum :			874,39				0,12				874,39		1,266%			
Máximo / Maximum :			942.713,17				17.996,71				942.713,17		3,897%			