

Importes expresados en euros

| | | | |
|--|--|------------------------------------|---|
| Fecha Constitución | 06/05/2005 | Directores Aseguramiento | CatalunyaCaixa, BBVA, BNP Paribas, JP Morgan Securities LTD, Nomura International PLC |
| Fecha Emisión Bonos | 06/05/2005 | Originador | CatalunyaCaixa |
| Fecha Desembolso | 12/05/2005 | Agente de Pagos | Societe Generale |
| Sociedad Gestora | Gestion de Activos Titulizados, SGFT, SA | Mercado Negociación | AIAF |
| Administrador | CatalunyaCaixa | Reg. Contable Valores | Iberclear |
| Cta. Tesorería a Tipo Garantizado | Societe Generale | Depositorio Participaciones | CatalunyaCaixa |
| Permutas Intereses | CECABANK | Audidores | Deloitte & Touche |
| Prestamo Subordinado | CatalunyaCaixa | Depósito garantía/liquidez | |
| Directores | CatalunyaCaixa, JP Morgan Securities LTD, BBVA | 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 ES0345784005 Preferente / Pass-Through | - % | 0,00€ 2.500 0,00€ | 100.000,00€ 2.500 250.000.000,00€ | Variable EURIB.3M+0,04% 15-3/6/9/12 | - % Fecha: 15-06-2016 Intereses: - | - 15-3/6/9/12 | | Aaa AAA AAA | Aaa AAA AAA |
| SERIE A2 ES0345784013 Preferente / Pass-Through | 25,30% | 25.303,70€ 11.555 292.384.253,50€ | 100.000,00€ 11.555 1.155.500.000,00€ | Variable EURIB.3M+0,14% 15-3/6/9/12 | -0,085% Fecha: 15-06-2016 Intereses: 0,00 € | 15-03-2038 15-3/6/9/12 | | A1 BBB- A | Aaa AAA AAA |
| SERIE B ES0345784021 Mezzanine / Pass-Through | 94,50% | 94.498,10€ 262 24.758.502,20€ | 100.000,00€ 262 26.200.000,00€ | Variable EURIB.3M+0,16% 15-3/6/9/12 | -0,065% Fecha: 15-06-2016 Intereses: 0,00 € | 15-03-2038 15-3/6/9/12 | | Baa1 BB BBB | Aa1 AA AA |
| SERIE C ES0345784039 Mezzanine / Pass-Through | 94,50% | 94.498,10€ 356 33.641.323,60€ | 100.000,00€ 356 35.600.000,00€ | Variable EURIB.3M+0,26% 15-3/6/9/12 | 0,035% Fecha: 15-06-2016 Intereses: 8,45 € | 15-03-2038 15-3/6/9/12 | | Ba3 B- BB | A1 A- A |
| SERIE D ES0345784047 Subordinada / Pass-Through | 94,50% | 94.498,10€ 327 30.900.878,70€ | 100.000,00€ 327 32.700.000,00€ | Variable EURIB.3M+0,46% 15-3/6/9/12 | 0,235% Fecha: 15-06-2016 Intereses: 56,75 € | 15-03-2038 15-3/6/9/12 | | Caa3 CCC CCC | Baa2 BBB- BBB+ |
| Totales | | 381.684.958,00 € | 1.500.000.000,00 € | | | | | | |

ACTIVO AGRUPADO: TIPO DE ACTIVO AGRUPADO

| General | Actual | Fecha de Constitución |
|--|-----------------|-----------------------|
| Principal | | |
| Número | 6.108 | 15.465 |
| Saldo Vivo | 368.787.115,64€ | 1.500.007.678,35€ |
| Medio | 59.999,10€ | 96.969,43€ |
| Mínimo | 56,75€ | 25.009,21€ |
| Máximo | 310.083,44€ | 467.820,55€ |
| Interés | | |
| Medio Ponderado | 1,6734% | 3,5388% |
| Mínimo | 0,4920% | 2,0470% |
| Máximo | 4,1410% | 5,5000% |
| Vida Residual (Meses) | | |
| Medio Ponderado | 182,98 | 295,52 |
| Mínimo | 0,99 | 6,87 |
| Máximo | 226,96 | 386,86 |
| Índice de referencia (Distib. en porcentaje sobre total de ppal PDTE) | | |
| Euribor 1 año | 55,24% | 45,72% |
| Mibor 1 Año | 0,16% | 0,34% |
| Préstamos Hipotecarios Cajas | 0,00% | 1,95% |
| Préstamos Hipotecarios Cajas TAE | 0,00% | 51,84% |
| Préstamos Hipotecarios Entidades | 44,60% | 0,00% |
| Tipo Activo CECA | 0,00% | 0,15% |

AMORTIZACION ANTICIPADA

| | Último mes | Últimos 3 meses | Últimos 6 meses | Últimos 12 meses | Histórica |
|---------------------------------|------------|-----------------|-----------------|------------------|-----------|
| Tasa Mensual Equivalente | 0,3703% | 0,3523% | 0,4358% | 0,3627% | 0,5329% |
| Tasa Anual Equivalente | 4,3542% | 4,1462% | 5,1056% | 4,2665% | 6,2110% |

DISTRIBUCIÓN GEOGRÁFICA

| | Actual | Fecha Constitución |
|----------------------|--------|--------------------|
| Catalunya | 83,25 | 81,40 |
| Madrid | 5,18 | 5,94 |
| Comunidad Valenciana | 5,48 | 6,05 |
| Baleares | 0,65 | 0,54 |
| Aragón | 0,79 | 1,10 |
| Andalucía | 1,05 | 1,15 |
| Murcia | 1,04 | 1,52 |
| Navarra | 0,28 | 0,30 |
| Otras comunidades | 2,28 | 2,00 |

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 | 89 | 26.711,28 € | 4.717,04 € | 31.428,32 € | 6.726.291,09 € | 6.753.002,37 € | 65,20% | 52,2672% |
| De 1 a 2 Meses | 33 | 22.055,38 € | 6.285,61 € | 28.340,99 € | 2.204.744,82 € | 2.226.800,20 € | 21,50% | 50,4645% |
| De 2 a 3 Meses | 17 | 16.813,77 € | 5.960,22 € | 22.773,99 € | 1.361.374,73 € | 1.378.188,50 € | 13,31% | 61,8490% |
| Totales | 139 | 65.580,43 € | 16.962,87 € | 82.543,30 € | 10.292.410,64 € | 10.357.991,07 € | 100,00% | 52,9545% |

(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 | 18 | 345,23 € | 0,00 € | 345,23 € | 1.633.288,30 € | 1.633.633,53 € | 13,70% | 74,2092% |
| De 1 a 2 Meses | 1 | 60,01 € | 0,00 € | 60,01 € | 21.533,32 € | 21.593,33 € | 0,18% | 16,1515% |
| De 2 a 3 Meses | 2 | 2.928,72 € | 1.051,50 € | 3.980,22 € | 315.973,35 € | 318.902,07 € | 2,68% | 59,6696% |
| De 3 a 6 Meses | 33 | 49.315,79 € | 12.667,41 € | 61.983,20 € | 2.506.194,24 € | 2.555.510,03 € | 21,44% | 55,2004% |
| De 6 a 12 Meses | 45 | 60.119,78 € | 20.575,52 € | 80.695,30 € | 3.784.431,01 € | 3.844.550,79 € | 32,25% | 67,0480% |
| De 12 a 18 Meses | 39 | 48.442,53 € | 30.129,59 € | 78.572,12 € | 3.497.401,76 € | 3.545.844,29 € | 29,75% | 70,9976% |
| Totales | 138 | 161.212,06 € | 64.424,02 € | 225.636,08 € | 11.758.821,98 € | 11.920.034,04 € | 100,00% | 65,3987% |

(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% | 16,67% | 250.000.000,00€ | 7,85% |
| SERIE A2 | 76,60% | 292.384.253,50€ | 23,40% | 77,03% | 1.155.500.000,00€ | 7,85% |
| SERIE B | 6,49% | 24.758.502,20€ | 16,91% | 1,75% | 26.200.000,00€ | 6,10% |
| SERIE C | 8,81% | 33.641.323,60€ | 8,10% | 2,37% | 35.600.000,00€ | 3,73% |
| SERIE D | 8,10% | 30.900.878,70€ | 0,00% | 2,18% | 32.700.000,00€ | 1,55% |
| Total | | 381.684.958,00 € | | | 1.500.000.000,00 € | |
| Fondo de Reserva Teórico | | 21.143.013,28€ | 5,54% | | 23.250.000,00€ | 1,55% |
| Fondo de Reserva Dotado | | 55,47€ | 0,00% | | 23.250.000,00€ | 1,55% |

OTRAS OPERACIONES FINANCIERAS (Actual)

| | Saldo | Interés |
|---|-----------------|---------|
| Activo | | |
| CUENTA DE TESORERÍA | 1.532.567,21 € | 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 | 16.536.065,94 € | 0,00% |
| PRÉSTAMO GASTOS INICIALES | 0,00 € | 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. | 9.053.351,95 € | 7.260,14 € |
| 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. | 84.769.631,34 € | 925.295,64 € |
| Recuperaciones sobre Write-Off acumulados | | |
| Recuperaciones de principal y recuperaciones por la venta de fincas adjudicadas. | 29.112.959,92 € | 422.864,19 € |
| | Actual | A la emisión |
| Déficit amortización o dotación de bonos | 16.409.255,50 € | 0,00 € |
| Ratio de morosidad | | |
| Saldo Vivo Impagados > 90 días / Saldo Vivo Total | 2,6969% | 0,0000% |
| Media Ponderada Principal / Valor Tasación | | |
| Tasación solo en Préstamos Hipotecarios | 51,6749% | 73,4101% |

INFORMACIÓN PERIODO EN ESPERA

| | |
|--|----------------|
| Saldo Vivo Ph's periodo en espera | 1.627.096,96 € |
| Intereses Devengados | 11.242,38 € |
| Ratio: (Saldo vivo GE + Intereses Devengados) / Saldo Vivo Total | 0,4443% |

PERMUTAS INTERÉS (Swap)

| | Principal Nocial | Interés |
|-------------|------------------|--------------|
| Swap | | |
| Receptor | A Determinar | 0,602781% |
| Pagador | A Determinar | A Determinar |

SITUACIÓN CARTERA

| | |
|---|---------------------------|
| Cartera Viva Actual | 368.787.115,64 € |
| Saldo Vivo al Corriente de Pago | 346.509.090,53 € |
| Saldo Vivo Impagados (< 3 meses) | 10.357.991,07 € |
| Saldo Vivo Dudosos y subjetivos | 11.920.034,04 € |
| - Proceso de ejecución de la garantía iniciado | 5.481.603,30 € |
| - Proceso de ejecución de la garantía no iniciado | 6.438.430,74 € |
| Cartera Amortizada | 1.095.896.368,98 € |
| Principal Cobrado desde la Constitución | 1.105.816.331,95 € |
| Capitalización Intereses Garantía en Espera | -9.919.962,97 € |
| Principal Actual de Fallidos | 35.324.193,73 € |
| Número de préstamos en Fallido | 551 |
| Total Titulizado | 1.500.007.678,35 € |

INFORMACIÓN ADICIONAL EN:

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

Registro Oficial: Comisión Nacional del Mercado de Valores

RESPONSABILIDAD CONTENIDO INFORMACIÓN:

EL DIRECTOR EJECUTIVO

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

Gestión de Activos Titulizados, SGFT, S.A.