

CAIXABANK RMBS 1, F.T.

INFORMACIÓN MENSUAL A 31/08/2021 / MONTHLY INFORMATION AS OF 31/08/2021

Fecha Constitución	24/02/2016	Fecha Desembolso	29/02/2016
Sociedad Gestora	CAIXABANK TITULIZACIÓN, SGFT, SAU	Directores y Aseguradores	CAIXABANK, S.A.
Originadores y Administradores	CAIXABANK, S.A.	Agente de Pagos	CAIXABANK, S.A.
Cta. Tesorería Tipo Garantizado	CAIXABANK, S.A.	Mercado Negociación	AIAF MERCADO RENTA FIJA
Préstamo Sub. Gastos Constitución	CAIXABANK, S.A.	Registro Contable de Valores	IBERCLEAR
Préstamo Sub. Fondo Reserva	CAIXABANK, S.A.	Audidores	PWC

1/ BONOS DE TITULIZACIÓN (ESTRUCTURA PREFERENTE/SUBORDINADA) /
SECURITISATION BONDS (SENIOR/SUBORDINATED STRUCTURE)

Serie Código ISIN Prelación	Fecha Emisión	Nominal Circulación (Unitario/Total)		Intereses	Tipo interés Bruto Actual Unitario	Fecha de Pago Final Próxima Frecuencia		Calificación Actual	
		Actual	Inicial			MOODY'S	DBRS		
"A" ES0305117006 Preferente	29/02/2016	64.741,22 128.510 Bonos 8.319.894.182,20	100.000,00 128.510 Bonos 12.851.000.000,00	Variable Euribor 3 Meses + 0,50% Trim	0,0000 % 0,00 ⁽³⁾	01/09/2059 (2) Trimestral	17/09/2021	Aa1(sf)	AA(sf)
"B" ES0305117014 Subordinada	29/02/2016	100.000,00 13.490 Bonos 1.349.000.000,00	100.000,00 13.490 Bonos 1.349.000.000,00	Variable Euribor 3 Meses + 0,65% Trim	0,1080 % 27,60 ⁽³⁾	01/09/2059 (2) Trimestral	17/09/2021	B2(sf)	BBB (low)(sf)
Totales		9.668.894.182,20	14.200.000.000,00						

VIDA MEDIA RESIDUAL EN AÑOS Y AMORTIZACIÓN FINAL ESTIMADAS SEGÚN TASAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA (4) /
RESIDUAL AVERAGE LIFE IN YEARS AND MATURITY ACCORDING TO ANNUAL PREPAYMENT RATES (CPR) (4)

TASA AMORTIZACIÓN ANTICIPADA									
% mensual constante		0.00	0.34	0.50	0.75	1.00	1.25	1.50	1.75
% anual equivalente		0.00	3.97	5.84	8.64	11.36	14.01	16.59	19.09
BONOS SERIE A	ISIN:ES0305117006								
Sin ejercicio amortización opcional									
Vida media		8.45	5.49	4.73	3.93	3.36	2.95	2.63	2.37
Amortización Final		17/06/2039	17/12/2032	17/09/2031	18/03/2030	18/12/2028	17/03/2028	17/06/2027	17/12/2026
Con ejercicio amortización opcional (1)									
Vida media		8.45	5.49	4.73	3.93	3.36	2.95	2.63	2.37
Amortización Final		17/03/2039	17/12/2032	17/09/2031	18/03/2030	18/12/2028	17/03/2028	17/06/2027	17/12/2026
BONOS SERIE B	ISIN:ES0305117014								
Sin ejercicio amortización opcional									
Vida media		22.94	13.07	11.58	9.96	8.79	7.90	7.19	6.60
Amortización Final		17/09/2059	17/09/2035	17/03/2034	17/06/2032	17/03/2031	17/06/2030	17/09/2029	18/12/2028
Con ejercicio amortización opcional (1)									
Vida media		18.01	11.92	10.40	8.88	7.86	7.09	6.34	5.82
Amortización Final		17/03/2039	17/03/2033	17/09/2031	18/03/2030	19/03/2029	19/06/2028	17/09/2027	17/03/2027

(1) Amortización a opción de la Sociedad Gestora cuando el importe del Principal pendiente de amortizar de los Activos Cedidos sea inferior al 10% del inicial y todas las obligaciones de pago derivadas de los Bonos puedan ser atendidas y canceladas en su totalidad.

(2) Fecha teórica de liquidación del Fondo de Titulización.

(3) Interés Bruto Unitario a pagar en el próximo cupón.

(4) Otros datos utilizados: Tasa Morosidad - 1,5821%, Tasa Recuperación Morosidad - 80,1426%, Tasa Fallidos - 1,4203% y Tasa Recuperación Fallidos - 25,1073%.

2/ ACTIVO AGRUPADO: PARTICIPACIONES HIPOTECARIAS / POOL: MORTGAGE LOANS

Préstamos Hipotecarios sobre Vivienda libre			
		Actual	Fecha Constitución
Principal Nominal	Número	120.968	147.871
	Importe	9.431.174.660,19	14.199.267.511,98
Principal Vivo	Número	120.969	147.871
	Importe	9.433.035.427,07	14.199.999.999,80
Interés	Media Pond	0,78 %	1,44 %
	Mínimo	0,00 %	0,00 %
	Máximo	7,85 %	9,60 %
Vida Residual (meses)	Media Pond	227,422	287,419
	Mínima	0,033	0,032
	Máxima	448,340	522,410

Amortización Anticipada				
	Último mes	Últimos tres meses	Últimos seis meses	Últimos doce meses
Tasa Mensual Constante	0,2441 %	0,3724 %	0,3625 %	0,3368 %
Tasa Anual Equivalente	2,8904 %	4,3782 %	4,2640 %	3,9678 %

Distribución Geográfica		
	Actual	Fecha Constitución
Cataluña	28,50 %	28,12 %
Madrid	19,26 %	20,15 %
Andalucía	12,85 %	12,87 %
Comunidad Valenciana	6,86 %	6,77 %
Asturias	2,28 %	2,24 %
Castilla y León	4,68 %	4,68 %
Otras Comunidades	25,57 %	25,17 %

Indice Referencia(Distribución en % sobre el total de particip.)		
EURIBOR OFICIAL	82,50 %	79,38 %
I.R.P.H. CONJUNTO ENTIDADES	11,19 %	15,50 %
V.P.O. MINISTERIO DE VIVIENDA 2005	3,84 %	3,63 %
MIBOR(IND.OF. NO EURIBOR)	0,45 %	0,58 %
Otros	2,02 %	0,91 %

Principal/Valor Tasación(PVT) - Valor Actual					
%Intervalo	%Cartera	%PVT	%Intervalo	%Cartera	%PVT
230.00- 239.99	0,00	238,49	210.00- 219.99	0,00	213,10
200.00- 209.99	0,00	205,76	190.00- 199.99	0,00	200,00
180.00- 189.99	0,00	183,13	170.00- 179.99	0,00	176,19
160.00- 169.99	0,00	162,23	150.00- 159.99	0,00	157,23
140.00- 149.99	0,00	145,14	130.00- 139.99	0,01	134,53
120.00- 129.99	0,02	125,10	110.00- 119.99	0,01	114,87
100.00- 109.99	0,05	103,91	90.00 - 99.99	0,17	93,83
80.00 - 89.99	1,48	83,50	70.00 - 79.99	7,82	74,01
60.00 - 69.99	17,17	64,88	50.00 - 59.99	28,54	54,66
40.00 - 49.99	32,21	45,61	30.00 - 39.99	9,81	36,23
20.00 - 29.99	2,17	26,23	10.00 - 19.99	0,45	16,31

Principal/Valor Tasación(PVT) - Valor Inicial					
%Intervalo	%Cartera	%PVT	%Intervalo	%Cartera	%PVT
230.00- 239.99	0,00	230,16	210.00- 219.99	0,00	216,81
200.00- 209.99	0,00	202,36	190.00- 199.99	0,00	193,65
180.00- 189.99	0,00	185,80	170.00- 179.99	0,01	174,56
160.00- 169.99	0,01	164,79	150.00- 159.99	0,01	154,00
140.00- 149.99	0,02	143,23	130.00- 139.99	0,02	133,84
120.00- 129.99	0,07	123,55	110.00- 119.99	0,12	114,13
100.00- 109.99	0,38	103,37	90.00 - 99.99	2,65	93,68
80.00 - 89.99	11,73	84,25	70.00 - 79.99	16,35	74,53
60.00 - 69.99	35,08	64,72	50.00 - 59.99	21,40	55,70
40.00 - 49.99	7,18	46,23	30.00 - 39.99	1,67	36,10
20.00 - 29.99	0,73	25,22	10.00 - 19.99	1,09	14,57

Medio Ponderada:	52,95
Mínimo:	0,02
Máximo:	238,49

Medio Ponderada:	64,25
Mínimo:	0,00
Máximo:	230,16

MOROSIDAD ACTUAL /CURRENT DELINQUENCY						
Antigüedad Deuda	Número Activos	Importe Impagado			Principal Pendiente no Vencido	Deuda Total
		Principal	Intereses Ordinarios	Total		
HASTA 1 MES	127	40.544,96	7.948,59	48.493,55	8.147.993,34	8.196.486,89
DE 1 A 2 MESES	113	56.684,13	15.646,44	72.330,57	8.468.128,96	8.540.459,53
DE 2 A 3 MESES	9	8.395,84	1.947,37	10.343,21	795.579,69	805.922,90
DE 3 A 6 MESES	410	427.066,89	120.556,75	547.623,64	34.823.723,80	35.371.347,44
DE 6 A 12 MESES	1.280	710.218,10	188.167,33	898.385,43	101.692.138,20	102.590.523,63
DE 12 A 18 MESES	156	617.856,96	159.483,41	777.340,37	10.970.132,92	11.747.473,29
DE 18 A 2 AÑOS	0	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
DE 2 A 3 AÑOS	0	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
MAS DE 3 AÑOS	0	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Totales	2.095	1.860.766,88	493.749,89	2.354.516,77	164.897.696,91	167.252.213,68

Subordinación y Fondo de Reserva / Subordination and Reserve Fund
Otras Operaciones Financieras / Other Financial Operations

Bonos Subordinados	Actual	A la emisión	Activo	Saldo Actual	Interés
	Fondo Reserva	13,95% 1.349.000.000,00	9,50% 1.349.000.000,00	Cuenta Tesorería T.I.G.	839.461.511,07
	5,87% 568.000.000,00	4,00% 568.000.000,00			

RESPONSABILIDAD CONTENIDO INFORMACION:

CAIXABANK TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.U.

www.caixabanktitulizacion.com