

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 9152
NIF Fondo: V85501005
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A-80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:
(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

S.01
Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	17.951	1001	22.547
I. Activos financieros a largo plazo	0002	17.951	1002	22.547
1. Activos titulizados	0003	17.951	1003	22.547
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	0	1005	0
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007	0	1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008	0	1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009	0	1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010	17.642	1010	22.325
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016	0	1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	0
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022	0	1022	0
1.20 Otros	0023	0	1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	309	1025	222
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	0
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

S.01

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	19.567	1041	21.639
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	4.912	1043	6.253
1. Activos titulizados	0044	4.469	1044	5.491
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	0	1046	0
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048	0	1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049	0	1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050	0	1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051	4.314	1051	5.374
1.8 Préstamos corporativos	0052	0	1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053	0	1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054	0	1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055	0	1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056	0	1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057	0	1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058	0	1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060	0	1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061	0	1061	0
1.18 Bonos de titulización	0062	0	1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063	0	1063	0
1.20 Otros	0064	0	1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	8	1065	12
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	4	1066	6
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	147	1067	104
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	5	1068	5
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-9	1069	-9
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	443	1074	761
3.1 Valores representativos de deuda	0075	0	1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076	0	1076	0
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	443	1077	761
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	0
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	14.654	1085	15.386
1. Tesorería	0086	14.654	1086	15.386
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	37.518	1088	44.186

S.01

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	32.284	1089	38.065
I. Provisiones a largo plazo	0090	0	1090	0
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	0	1092	0
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	32.284	1094	38.065
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	18.433	1095	23.844
1.1 Series no subordinadas	0096	0	1096	0
1.2 Series subordinadas	0097	18.433	1097	23.844
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	13.851	1101	14.222
2.1 Préstamo subordinado	0102	18.891	1102	18.891
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-5.040	1105	-4.669
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	0	1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

S.01

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) PASIVO CORRIENTE	0117	5.276	1117	6.203
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	0119	0	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	5.265	1123	6.193
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	4.486	1124	5.510
1.1 Series no subordinadas	0125	0	1125	875
1.2 Series subordinadas	0126	4.461	1126	4.603
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	25	1128	33
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	726	1131	585
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	0	1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	12	1136	16
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	714	1137	568
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	53	1139	98
3.1 Derivados de cobertura	0140	53	1140	98
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	10	1148	10
1. Comisiones	0149	5	1149	5
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	4	1150	4
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	1152	1
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	5	1157	5
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-41	1158	-83
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-41	1160	-83
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	37.518	1162	44.186

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	56	1201	89	2201	266	3201	437
1.1 Activos titulizados	0202	56	1202	89	2202	266	3202	433
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	3
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-99	1204	-132	2204	-429	3204	-566
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-66	1205	-88	2205	-286	3205	-379
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-32	1206	-44	2206	-141	3206	-186
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-1	1207	0	2207	-2	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-30	1208	-37	2208	-134	3208	-180
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-73	1209	-81	2209	-298	3209	-309
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210	0	3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-29	1217	-28	2217	-73	3217	-73
7.1 Servicios exteriores	0218	-11	1218	-10	2218	-15	3218	-15
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-11	1219	-10	2219	-15	3219	-15
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-18	1224	-18	2224	-58	3224	-58
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-10	1225	-10	2225	-40	3225	-40
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-3	2227	-13	3227	-13
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-5	1230	-5	2230	-6	3230	-6
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	0	2231	0	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	0	2232	0	3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234	0	3234	0
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236	0	3236	0
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238	0	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	102	1239	109	2239	371	3239	383
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-55	1300	-48	2300	-214	3300	-185
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-42	1301	-35	2301	-162	3301	-132
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	58	1302	94	2302	271	3302	442
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-67	1303	-91	2303	-294	3303	-388
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-32	1305	-38	2305	-138	3305	-190
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	5
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-1	1308	0	2308	-2	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-13	1309	-13	2309	-53	3309	-53
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-10	1310	-10	2310	-40	3310	-40
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-3	1312	-3	2312	-13	3312	-13
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	0	1315	0	2315	0	3315	0
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-325	1322	-1.763	2322	-517	3322	-1.890
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-314	1325	-1.753	2325	-497	3325	-1.870
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	1.793	1326	1.692	2326	5.009	3326	4.998
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	0	1327	472	2327	543	3327	2.705
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	27	1328	54	2328	379	3328	354
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-2.134	1331	-3.972	2331	-6.427	3331	-9.927
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-11	1332	-10	2332	-21	3332	-21
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-11	1336	-10	2336	-21	3336	-21
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-380	1337	-1.811	2337	-732	3337	-2.075
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	15.035	1338	17.198	2338	15.386	3338	17.461
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	14.654	1339	15.386	2339	14.654	3339	15.386

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	13	1357	-3	2357	-93	3357	90
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	13	1358	-3	2358	-93	3358	90
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359	0	3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	30	1360	37	2360	134	3360	180
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361	0	3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-43	1362	-34	2362	-42	3362	-270
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BMN

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2016								Situación cierre anual anterior 31/12/2015								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381		0401		0421		0441		1381		1401		1421		1441		2381		2401		2421		2441	
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386	2,03	0406	0,00	0426	0,00	0446	2,33	1386	1,16	1406	0,00	1426	0,00	1446	8,70	2386	0,00	2406	0,00	2426	0,00	2446	8,00
Prestamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BMN

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	9	0467	4	0474	0	0481	0	0488	5	0495	1.080	0502	0	0509	1.085
De 1 a 3 meses	0461	2	0468	8	0475	3	0482	0	0489	12	0496	394	0503	0	0510	406
De 3 a 6 meses	0462	0	0469	0	0476	0	0483	0	0490	0	0497	0	0504	0	0511	0
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	11	0477	0	0484	0	0491	12	0498	118	0505	0	0512	130
De 9 a 12 meses	0464	0	0471	0	0478	0	0485	0	0492	0	0499	0	0506	0	0513	0
Más de 12 meses	0465	4	0472	62	0479	5	0486	8	0493	74	0500	265	0507	0	0514	339
Total	0466	16	0473	86	0480	9	0487	8	0494	103	0501	1.858	0508	0	1515	1.960

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total		Valor garantía		Valor Garantía con Tasación > 2 años		% Deuda / v. Tasación	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total													
Hasta 1 mes	0515	8	0522	3	0529	0	0536	0	0543	3	0550	1.019	0557	0	0564	1.023	0571	8.747	0578	8.747	0584	11,69
De 1 a 3 meses	0516	1	0523	2	0530	0	0537	0	0544	2	0551	86	0558	0	0565	88	0572	251	0579	251	0585	35,03
De 3 a 6 meses	0517	0	0524	0	0531	0	0538	0	0545	0	0552	0	0559	0	0566	0	0573	0	0580	0	0586	0,00
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	11	0532	0	0539	0	0546	12	0553	118	0560	0	0567	130	0574	600	0581	600	0587	21,73
De 9 a 12 meses	0519	0	0526	0	0533	0	0540	0	0547	0	0554	0	0561	0	0568	0	0575	0	0582	0	0588	0,00
Más de 12 meses	0520	2	0527	53	0534	5	0541	8	0548	66	0555	265	0562	0	0569	330	0576	720	0583	720	0589	45,82
Total	0521	12	0528	70	0535	6	0542	8	0549	83	0556	1.488	0563	0	0570	1.571	0577	10.318			0590	15,23

S.05.1

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BMN

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 31/07/2008	
Inferior a 1 año	0600	457	1600	557	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	261	1601	1.376	2601	876
Entre 2 y 3 años	0602	1.348	1602	409	2602	6.639
Entre 3 y 4 años	0603	1.284	1603	1.942	2603	26.838
Entre 4 y 5 años	0604	5.579	1604	1.704	2604	13.030
Entre 5 y 10 años	0605	8.509	1605	15.665	2605	63.788
Superior a 10 años	0606	4.974	1606	6.371	2606	138.830
Total	0607	22.412	1607	28.025	2607	250.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	6,92	1608	7,40	2608	10,12

Antigüedad	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 31/07/2008	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	11,61	1609	10,68	2609	3,32

S.05.1

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BMN

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 31/07/2008			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	118	0630	19.374	1620	121	1630	24.136	2620	182	2630	117.446
40% - 60%	0621	10	0631	2.098	1621	15	1631	2.590	2621	117	2631	72.348
60% - 80%	0622	1	0632	317	1622	1	1632	332	2622	36	2632	20.103
80% - 100%	0623	0	0633	0	1623	0	1633	0	2623	12	2633	3.627
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	129	0638	21.789	1628	137	1638	27.058	2628	347	2638	213.523
Media ponderada (%)			0639	22,15			1639	24,21			2639	39,30

S.05.1

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BMN

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 31/07/2008	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,04	1650	1,29	2650	5,82
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,00	1651	4,00	2651	7,88
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,38	1652	0,46	2652	4,65

S.05.1

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BMN

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 31/07/2008			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	0	0683	0	1660	0	1683	0	2660	3	2683	4.096
Aragón	0661	0	0684	0	1661	0	1684	0	2661	0	2684	0
Asturias	0662	0	0685	0	1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663	136	0686	22.374	1663	149	1686	27.973	2663	599	2686	215.311
Canarias	0664	1	0687	38	1664	1	1687	52	2664	5	2687	366
Cantabria	0665	0	0688	0	1665	0	1688	0	2665	0	2688	0
Castilla-León	0666	0	0689	0	1666	0	1689	0	2666	0	2689	0
Castilla La Mancha	0667	0	0690	0	1667	0	1690	0	2667	1	2690	83
Cataluña	0668	0	0691	0	1668	0	1691	0	2668	6	2691	4.063
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	0	2693	0
Galicia	0671	0	0694	0	1671	0	1694	0	2671	0	2694	0
Madrid	0672	0	0695	0	1672	0	1695	0	2672	19	2695	25.639
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	0	0697	0	1674	0	1697	0	2674	0	2697	0
Navarra	0675	0	0698	0	1675	0	1698	0	2675	1	2698	9
La Rioja	0676	0	0699	0	1676	0	1699	0	2676	0	2699	0
Comunidad Valenciana	0677	0	0700	0	1677	0	1700	0	2677	3	2700	433
País Vasco	0678	0	0701	0	1678	0	1701	0	2678	0	2701	0
Total España	0679	137	0702	22.412	1679	150	1702	28.025	2679	637	2702	250.000
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	137	0705	22.412	1682	150	1705	28.025	2682	637	2705	250.000

S.05.1
Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016
Entidades cedentes de los activos titulizados: BMN

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 31/07/2008			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	52,53			1710	49,62			2710	24,17		
Sector	0711	40,53	0712	55	1711	42,59	1712	55	2711	32,22	2712	55

S.05.2

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016			Situación cierre anual anterior 31/12/2015			Situación inicial 31/07/2008					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0377969003	SERIE A	1.912	0	0	1.912	458	875	1.912	100.000	191.200			
ES0377969011	SERIE B	250	25.947	6.487	250	48.157	12.039	250	100.000	25.000			
ES0377969029	SERIE C	140	48.157	6.742	140	48.157	6.742	140	100.000	14.000			
ES0377969037	SERIE D	138	48.157	6.646	138	48.157	6.646	138	100.000	13.800			
ES0377969045	SERIE E	60	50.328	3.020	60	50.328	3.020	60	100.000	6.000			
Total		0723	2.500	0724	22.894	1723	2.500	1724	29.321	2723	2.500	2724	250.000

S.05.2
Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/12/2016
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses					Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas				
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado							
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739					
ES0377969003	SERIE A	NS	EURIBOR 3 m	0,30	0,00	0	0	SI	0	0	0	0					
ES0377969011	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,19	1	0	SI	6.487	0	6.488	0					
ES0377969029	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	1,25	0,94	6	0	SI	6.742	0	6.748	0					
ES0377969037	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	2,00	1,69	11	0	SI	6.646	0	6.657	0					
ES0377969045	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,50	2,19	7	0	SI	3.020	0	3.026	0					
Total						0740	25	0741	0	0743	22.894	0744	0	0745	22.919	0746	0

	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 31/07/2008	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	1,06	0748	1,08	0749	5,52

S.05.2

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2015							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0377969003	SERIE A	0	191.200	0	8.766	3.972	190.325	3	8.766								
ES0377969011	SERIE B	2.134	18.513	4	2.279	0	12.961	14	2.248								
ES0377969029	SERIE C	0	7.258	16	1.899	0	7.258	21	1.828								
ES0377969037	SERIE D	0	7.154	29	2.484	0	7.154	33	2.364								
ES0377969045	SERIE E	0	2.980	17	1.282	0	2.980	19	1.212								
Total		0754	2.134	0755	227.106	0756	67	0757	16.711	1754	3.972	1755	220.679	1756	91	1757	16.417

S.05.2

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 31/07/2008
				0762	0763	0764
ES0377969003	SERIE A	31/07/2012	FCH	A	A	AAA
ES0377969011	SERIE B	05/08/2008	FCH	A	A	A
ES0377969029	SERIE C	06/07/2015	FCH	BB	BB	BBB-
ES0377969037	SERIE D	06/07/2015	FCH	BB	BB	BB-
ES0377969045	SERIE E	06/07/2015	FCH	BB	BB	B

S.05.2
Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/12/2016
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 31/07/2008	
Inferior a 1 año	0765	22.894	1765	5.509	2765	24.283
Entre 1 y 2 años	0766	0	1766	23.813	2766	26.838
Entre 2 y 3 años	0767	0	1767	0	2767	29.498
Entre 3 y 4 años	0768	0	1768	0	2768	31.651
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	0	2769	19.749
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	0	2770	76.443
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	41.537
Total	0772	22.894	1772	29.321	2772	250.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,16	1773	1,13	2773	11,49

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 31/07/2008	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	14.238	1775	14.743	2775	29.750
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	14.875	1776	14.875	2776	29.750
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	62,19	1777	50,28	2777	11,90
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Banco Mare Nostrum	1778	Banco Mare Nostrum	2778	Caja de Ahorros y Monte de Piedad de las Baleares (SA NOSTRA)
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786		1786		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792		1792	2,98	2792	76,48
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 31/07/2008	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	CREDIT AGRICOLE	TRIMESTRAL	Media de los Euribor 12M en cada Fecha de Referencia	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de los DC no Fallidas en base al periodo de revisión del tipo de interés (anual, semestral y trimestral)	Tipo de Referencia de los Bonos -0,02%%	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de los DC no Fallidas en base al periodo de revisión del tipo de interés (anual, semestral y trimestral)	-53	-98		
Total							0808 -53	0809 -98	0810	

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 31/07/2008		Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 31/07/2008			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	130	7006	317	7009	0,59	7012	1,13	7015	0,76		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	130	7008	317	7011	0,59	7014	1,13	7017	0,76	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	326	7024	9	7027	1,46	7030	0,03	7033	1,40		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	326	7026	9	7029	1,46	7032	0,03	7035	1,40	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
SERIE C - ES0377969029	2,50	0,59	0,76	4.9.2.2 Nota de Valores
SERIE C - ES0377969029	10,00	8,83	9,17	4.9.2.2 Nota de Valores
SERIE D - ES0377969037	11,04	29,03	26,55	4.9.2.2 Nota de Valores
SERIE D - ES0377969037	2,00	0,59	0,76	4.9.2.2 Nota de Valores
SERIE D - ES0377969037	10,00	8,83	9,17	4.9.2.2 Nota de Valores
SERIE E - ES0377969045	4,80	13,19	12,07	4.9.2.2 Nota de Valores
SERIE E - ES0377969045	1,50	0,59	0,76	4.9.2.2 Nota de Valores
SERIE E - ES0377969045	10,00	8,83	9,17	4.9.2.2 Nota de Valores
SERIE C - ES0377969029	11,20	29,45	26,94	4.9.2.2 Nota de Valores
SERIE B - ES0377969011	20,00	28,33	34,45	4.9.2.2 Nota de Valores
SERIE B - ES0377969011	3,00	0,59	0,76	4.9.2.2 Nota de Valores
SERIE B - ES0377969011	10,00	8,83	9,17	4.9.2.2 Nota de Valores
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0377969029	50,00	5,94	15,24	3.4.6.2.2. Modulo Adicional
SERIE B - ES0377969011	50,00	3,33	8,54	3.4.6.2.2. Modulo Adicional
SERIE D - ES0377969037	50,00	6,03	15,47	3.4.6.2.2. Modulo Adicional
SERIE E - ES0377969045	50,00	13,87	35,57	3.4.6.2.2. Modulo Adicional
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		62,19	57,16	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862	10	2862		3862		4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, S.E.	1864	3	2864	Saldo Nominal pendiente de vencimiento de los Derechos de Crédito agrupados en el Fondo en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3864	0,004	4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Banco Mare Nostrum
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.3.2.

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)	Fecha cálculo	Fecha cálculo										Total	
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872												
Margen de intereses	0873												
Deterioro de activos financieros (neto)	0874												
Dotaciones a provisiones (neto)	0875												
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876												
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877												
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878												
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879												
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880												
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881												
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882												
Comisión variable pagada	0883												
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884												

S.05.5

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo				Total
		25/02/2016	25/05/2016	25/08/2016	25/11/2016	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885					
Saldo inicial	0886	14.743	14.633	14.622	14.305	
Cobros del periodo	0887	1.757	1.410	1.070	2.190	
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-17	-18	-14	-24	
Pagos por derivados	0889	-36	-36	-33	-32	
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-14.633	-14.622	-14.305	-14.238	
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-1.815	-1.367	-1.339	-2.201	
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0	0	
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0	0	
Saldo disponible	0894	0	0	0	0	
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0	0	0

S.06

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 1, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

INFORME SOBRE EL CUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE RIESGOS