

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8531
NIF Fondo: V84856319
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2018

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: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	229.115	1001	249.248
I. Activos financieros a largo plazo	0002	229.115	1002	249.248
1. Activos titulizados	0003	229.115	1003	249.248
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	179.364	1004	194.579
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	43.433	1005	47.795
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	0	1010	0
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	6.363	1025	6.929
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-46	1027	-55
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

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	39.060	1041	42.200
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	20.676	1043	21.615
1. Activos titulizados	0044	20.384	1044	21.127
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	16.416	1045	17.057
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	2.888	1046	3.049
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	0	1051	0
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	169	1065	189
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	12	1066	18
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	888	1067	820
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	55	1068	56
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-43	1069	-61
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	292	1074	488
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	292	1077	488
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	
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	18.385	1085	20.585
1. Tesorería	0086	18.385	1086	20.585
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	268.175	1088	291.448

S.01

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	253.064	1089	274.969
I. Provisiones a largo plazo	0090	7.921	1090	7.694
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	7.921	1092	7.694
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	245.143	1094	267.275
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	232.575	1095	254.259
1.1 Series no subordinadas	0096	205.474	1096	224.754
1.2 Series subordinadas	0097	27.101	1097	29.505
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	7.460	1101	7.908
2.1 Préstamo subordinado	0102	5.055	1102	5.504
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	2.404	1103	2.404
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	0
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	5.108	1108	5.108
3.1 Derivados de cobertura	0109	5.108	1109	5.108
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

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) PASIVO CORRIENTE	0117	22.143	1117	22.879
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	22.127	1123	22.864
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	20.195	1124	20.930
1.1 Series no subordinadas	0125	20.191	1125	20.925
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	4	1128	5
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	6	1131	7
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	6	1136	7
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	1.923	1139	1.923
3.1 Derivados de cobertura	0140	1.923	1140	1.923
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	2	1143	4
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	2	1146	4
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	15	1148	15
1. Comisiones	0149	10	1149	10
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	8	1150	8
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	2
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	6	1157	6
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-7.032	1158	-6.401
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-7.032	1160	-6.401
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	268.175	1162	291.448

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2018		Acumulado anterior 30/06/2017
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	1.157	1201	1.479	2201	2.370	3201	3.035
1.1 Activos titulizados	0202	1.157	1202	1.479	2202	2.370	3202	3.035
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-31	1204	-34	2204	-64	3204	-71
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-7	1205	-8	2205	-13	3205	-16
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-9	1206	-10	2206	-18	3206	-21
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-16	1207	-17	2207	-33	3207	-34
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-200	1208	-641	2208	-647	3208	-1.310
A) MARGEN DE INTERESES	0209	926	1209	804	2209	1.659	3209	1.655
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	-507	1217	-830	2217	-1.460	3217	-2.615
7.1 Servicios exteriores	0218	-13	1218	-7	2218	-40	3218	-25
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-13	1219	-7	2219	-40	3219	-25
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	-494	1224	-823	2224	-1.420	3224	-2.589
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-14	1225	-14	2225	-27	3225	-27
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-2	1227	-2	2227	-4	3227	-5
7.3.4 Comisión variable	0228	-478	1228	-807	2228	-1.389	3228	-2.558
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	21	1231	43	2231	28	3231	49
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	21	1232	43	2232	28	3232	49
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	-440	1234	-17	2234	-227	3234	911
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	-440	1236	-17	2236	-227	3236	911
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	0	1239	0	2239	0	3239	0
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: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2018		Acumulado anterior 30/06/2017
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	160	1300	-17	2300	-368	3300	-988
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	654	1301	806	2301	1.053	3301	1.602
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.168	1302	1.492	2302	2.397	3302	3.067
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-7	1303	-8	2303	-14	3303	-17
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	-481	1305	-651	2305	-1.278	3305	-1.391
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-9	1307	-10	2307	-18	3307	-22
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-17	1308	-17	2308	-34	3308	-35
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-494	1309	-822	2309	-1.420	3309	-2.589
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-14	1310	-13	2310	-27	3310	-27
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-2	1312	-2	2312	-5	3312	-5
2.4 Comisión variable	0313	-478	1313	-807	2313	-1.389	3313	-2.558
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	-46	1322	943	2322	-1.833	3322	56
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	175	1325	1.151	2325	-1.344	3325	500
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	4.653	1326	5.091	2326	9.759	3326	10.367
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	5.610	1327	5.061	2327	10.749	3327	9.310
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	312	1328	1.053	2328	566	3328	1.659
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	-10.400	1331	-10.053	2331	-22.418	3331	-20.836
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-221	1332	-208	2332	-488	3332	-444
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	-208	1334	-201	2334	-448	3334	-417
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-13	1336	-7	2336	-40	3336	-28
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	114	1337	926	2337	-2.200	3337	-932
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	18.270	1338	19.079	2338	20.585	3338	20.937
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	18.385	1339	20.005	2339	18.385	3339	20.005

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2018		Acumulado anterior 30/06/2017
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	-481	1357	-651	2357	-1.278	3357	-1.391
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-481	1358	-651	2358	-1.278	3358	-1.391
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	200	1360	641	2360	647	3360	1.310
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	281	1362	10	2362	631	3362	81
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: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2018								Situación cierre anual anterior 31/12/2017								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	2,71	0400	0,00	0420	0,00	0440	8,21	1380	2,67	1400	0,00	1420	0,00	1440	7,61	2380	0,00	2400	0,00	2420	0,00	2440	12,00
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	3,72	0401	0,00	0421	0,00	0441	10,40	1381	3,67	1401	0,00	1421	0,00	1441	7,32	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	12,00
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		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos 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: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

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	119	0467	36	0474	9	0481	0	0488	44	0495	8.225	0502	0	0509	8.269
De 1 a 3 meses	0461	23	0468	19	0475	4	0482	0	0489	23	0496	1.459	0503	0	0510	1.482
De 3 a 6 meses	0462	2	0469	24	0476	6	0483	2	0490	33	0497	212	0504	0	0511	245
De 6 a 9 meses	0463	5	0470	16	0477	4	0484	6	0491	25	0498	476	0505	0	0512	501
De 9 a 12 meses	0464	2	0471	6	0478	2	0485	2	0492	10	0499	194	0506	0	0513	203
Más de 12 meses	0465	59	0472	363	0479	43	0486	138	0493	543	0500	5.960	0507	0	0514	6.504
Total	0466	210	0473	463	0480	67	0487	148	0494	678	0501	16.526	0508	0	1515	17.205

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	119	0522	36	0529	9	0536	0	0543	44	0550	8.225	0557	0	0564	8.269	0571	21.327	0578	21.327	0584	38,77
De 1 a 3 meses	0516	23	0523	19	0530	4	0537	0	0544	23	0551	1.459	0558	0	0565	1.482	0572	3.847	0579	3.847	0585	38,54
De 3 a 6 meses	0517	2	0524	24	0531	6	0538	2	0545	33	0552	212	0559	0	0566	245	0573	433	0580	433	0586	56,52
De 6 a 9 meses	0518	5	0525	16	0532	4	0539	6	0546	25	0553	476	0560	0	0567	501	0574	1.050	0581	1.050	0587	47,75
De 9 a 12 meses	0519	2	0526	6	0533	2	0540	2	0547	10	0554	194	0561	0	0568	203	0575	311	0582	311	0588	65,40
Más de 12 meses	0520	59	0527	363	0534	43	0541	138	0548	543	0555	5.960	0562	0	0569	6.504	0576	11.514	0583	11.514	0589	56,49
Total	0521	210	0528	463	0535	67	0542	148	0549	678	0556	16.526	0563	0	0570	17.205	0577	38.482			0590	44,71

S.05.1
Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 17/10/2006	
Inferior a 1 año	0600	348	1600	268	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	951	1601	948	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.554	1602	1.717	2602	70
Entre 3 y 4 años	0603	2.075	1603	2.166	2603	115
Entre 4 y 5 años	0604	4.140	1604	4.090	2604	383
Entre 5 y 10 años	0605	41.387	1605	39.943	2605	16.156
Superior a 10 años	0606	198.897	1606	221.097	2606	983.275
Total	0607	249.352	1607	270.228	2607	1.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	13,51	1608	13,93	2608	24,12

Antigüedad	Situación actual 30/06/2018					
	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 17/10/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	14,35	1609	13,84	2609	2,64

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 17/10/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	2.370	0630	94.842	1620	2.360	1630	95.470	2620	1.089	2630	74.034
40% - 60%	0621	1.602	0631	129.474	1621	1.766	1631	143.279	2621	1.908	2631	181.627
60% - 80%	0622	221	0632	24.416	1622	273	1632	30.860	2622	4.743	2632	566.677
80% - 100%	0623	4	0633	619	1623	4	1633	619	2623	1.230	2633	177.662
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	4.197	0638	249.352	1628	4.403	1638	270.228	2628	8.970	2638	1.000.000
Media ponderada (%)	0639	42,66	0649		1639	43,91	1649		2639	68,43	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 17/10/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,93	1650	2,00	2650	3,73
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,44	1651	4,44	2651	5,29
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	2,75

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 17/10/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	2	0683	112	1660	2	1683	116	2660	5	2683	779
Aragón	0661	24	0684	847	1661	25	1684	897	2661	55	2684	4.469
Asturias	0662	0	0685	0	1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663	0	0686	0	1663	0	1686	0	2663	0	2686	0
Canarias	0664	0	0687	0	1664	0	1687	0	2664	0	2687	0
Cantabria	0665	0	0688	0	1665	0	1688	0	2665	0	2688	0
Castilla-León	0666	0	0689	0	1666	0	1689	0	2666	2	2689	127
Castilla La Mancha	0667	0	0690	0	1667	0	1690	0	2667	3	2690	447
Cataluña	0668	4.099	0691	245.444	1668	4.299	1691	266.022	2668	8.724	2691	977.379
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	1	0694	61	1671	1	1694	62	2671	1	2694	95
Madrid	0672	1	0695	142	1672	2	1695	149	2672	41	2695	5.448
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	0	2698	0
La Rioja	0676	1	0699	10	1676	1	1699	22	2676	1	2699	70
Comunidad Valenciana	0677	69	0700	2.735	1677	73	1700	2.962	2677	136	2700	11.017
País Vasco	0678	0	0701	0	1678	0	1701	0	2678	2	2701	168
Total España	0679	4.197	0702	249.352	1679	4.403	1702	270.228	2679	8.970	2702	1.000.000
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	4.197	0705	249.352	1682	4.403	1705	270.228	2682	8.970	2705	1.000.000

S.05.1
Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 17/10/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,01			1710	0,97			2710	0,41		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2018			Situación cierre anual anterior 31/12/2017			Situación inicial 17/10/2006					
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			
ES0313252001	SERIE A	9.500	23.754	225.665	9.500	25.861	245.679	9.500	100.000	950.000			
ES0313252019	SERIE B	290	54.203	15.719	290	59.010	17.113	290	100.000	29.000			
ES0313252027	SERIE C	210	54.203	11.383	210	59.010	12.392	210	100.000	21.000			
Total		0723	10.000	0724	252.766	1723	10.000	1724	275.184	2723	10.000	2724	1.000.000

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

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		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
						0730	0731		0732	0733	0734	0735			0742	0736	0737
ES0313252001	SERIE A	NS	EURIBOR 3 m	0,14	0,00	0	0	SI	225.665	0	0	0	225.665	0			
ES0313252019	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,33	0,00	0	0	SI	15.719	0	0	0	15.719	0			
ES0313252027	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,55	0,22	4	0	SI	11.383	0	0	0	11.387	0			
Total						0740	4	0741	0	0743	252.766	0744	0	0745	252.771	0746	0

	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 17/10/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,01	0748	0,01	0749	0,00

S.05.2
Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2018
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2018								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2017							
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	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0313252001	SERIE A	9.285	724.335	0	118.499	8.976	684.484	0	118.499	0	118.499	0	118.499	0	118.499	0	118.499
ES0313252019	SERIE B	647	13.281	0	5.123	625	10.505	0	5.123	0	5.123	0	5.123	0	5.123	0	5.123
ES0313252027	SERIE C	468	9.617	7	4.199	453	7.607	8	4.170	8	4.170	8	4.170	8	4.170	8	4.170
Total		0754	10.400	0755	747.234	0756	7	0757	127.821	1754	10.053	1755	702.597	1756	8	1757	127.793

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

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 30/06/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 17/10/2006
				0762	0763	0764
ES0313252001	SERIE A	10/03/2017	FCH	A+	A+	AAA
ES0313252001	SERIE A	06/06/2018	SYP	A-	BBB+	AAA
ES0313252019	SERIE B	10/03/2017	FCH	BBB	BBB	A+
ES0313252019	SERIE B	06/06/2018	SYP	BB-	B+	A
ES0313252027	SERIE C	10/03/2017	FCH	BB	BB	BBB+
ES0313252027	SERIE C	06/06/2018	SYP	B-	B-	BBB

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

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 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 17/10/2006	
Inferior a 1 año	0765	23.366	1765	24.859	2765	21.257
Entre 1 y 2 años	0766	19.240	1766	20.112	2766	29.709
Entre 2 y 3 años	0767	18.995	1767	19.924	2767	31.138
Entre 3 y 4 años	0768	18.781	1768	19.668	2768	32.549
Entre 4 y 5 años	0769	18.363	1769	19.397	2769	33.944
Entre 5 y 10 años	0770	59.969	1770	72.146	2770	184.988
Superior a 10 años	0771	94.052	1771	99.079	2771	666.415
Total	0772	252.766	1772	275.184	2772	1.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	9,08	1773	9,08	2773	24,53

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 17/10/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	5.055	1775	5.504	2775	10.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	5.055	1776	5.504	2776	10.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	2,00	1777	2,00	2777	1,00
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Banco Sabadell	1778	Banco Sabadell	2778	Caixa de Estalvis del Penedes
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	1.797	1781	1.743	2781	5.000
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0,71	1782	0,63	2782	0,50
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Banco Sabadell	1783	Banco Sabadell	2783	Caixa de Estalvis del Penedes
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	89,28	1792	89,28	2792	95,00
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	

CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

S.05.3

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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 30/06/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 17/10/2006	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	JP MORGAN SECURITIES PLC	TRIMESTRAL	Media de los Euribor 12M en cada Fecha de Referencia	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de las PH y CTH no Fallidas	Tipo de Referencia de los Bonos - 0,10%	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de las PH y CTH no Fallidas	-7.032	-7.032		
Total							0808 -7.032	0809 -7.032	0810	

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 17/10/2006		Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 17/10/2006			
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	

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	381	7006	1.243	7009	0,16	7012	0,47	7015	0,21		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	381	7008	1.243	7011	0,16	7014	0,47	7017	0,21	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	6.971	7024	6.880	7027	2,80	7030	2,55	7033	2,72		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	90	7025	90	7028	0,04	7031	0,03	7034	0,03		
Total Fallidos					7023	7.062	7026	6.970	7029	2,83	7032	2,58	7035	2,76	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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 B - ES0313252019	10,00	10,72	10,72	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE B - ES0313252019	10,00	24,94	26,00	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE C - ES0313252027	10,00	10,72	10,72	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE B - ES0313252019	1,50	0,16	0,21	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE C - ES0313252027	10,00	24,94	26,00	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE C - ES0313252027	1,50	0,16	0,21	Nota de Valores 4.9.2.2
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0313252027	4,90	3,40	3,39	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE B - ES0313252019	7,50	3,40	3,39	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		2,00	2,00	3.4.2.1. 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

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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		2862	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las Participaciones y Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,015	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	2	2864		3864		4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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 Sabadell
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											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														

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
		29/01/2018	30/04/2018										
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885												
Saldo inicial	0886	7.517	7.035										
Cobros del periodo	0887	13.544	11.429										
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-44	-29										
Pagos por derivados	0889	-797	-481										
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-5.263	-5.055										
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-12.025	-10.406										
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-250	-217										
Resto pagos/retenciones	0893	0	0										
Saldo disponible	0894	2.682	2.275										
Liquidación de comisión variable	0895	910	478										1.389

S.06

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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