

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8772
NIF Fondo: V85143659
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: 31/12/2021

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 PYMES 1 TDA, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2021		Periodo anterior 31/12/2020
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	23.629	1001	29.423
I. Activos financieros a largo plazo	0002	23.629	1002	29.423
1. Activos titulizados	0003	23.629	1003	29.423
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	20.483	1010	25.926
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	3.182	1025	3.518
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-36	1027	-21
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: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	15.453	1041	16.369
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	526	1042	469
V. Activos financieros a corto plazo	0043	6.793	1043	8.238
1. Activos titulizados	0044	6.793	1044	8.228
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	4.058	1051	4.888
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	18	1065	24
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	1	1066	3
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	2.886	1067	3.469
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	50	1068	59
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-219	1069	-216
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	0	1074	9
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	0	1077	9
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	8.134	1085	7.662
1. Tesorería	0086	8.134	1086	7.662
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	39.081	1088	45.791

S.01

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2021		Periodo anterior 31/12/2020
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	32.135	1089	37.432
I. Provisiones a largo plazo	0090	7.233	1090	7.827
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	7.233	1092	7.827
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	24.902	1094	29.605
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	17.950	1095	22.653
1.1 Series no subordinadas	0096	0	1096	0
1.2 Series subordinadas	0097	17.950	1097	22.653
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	6.952	1101	6.952
2.1 Préstamo subordinado	0102	6.952	1102	6.952
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	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	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: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) PASIVO CORRIENTE	0117	6.965	1117	8.388
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	6.954	1123	8.383
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	6.944	1124	8.358
1.1 Series no subordinadas	0125	0	1125	0
1.2 Series subordinadas	0126	6.944	1126	8.357
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	0	1128	0
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	0	1131	0
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	0	1136	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	10	1139	24
3.1 Derivados de cobertura	0140	10	1140	24
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	1	1143	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	1	1146	1
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	10	1148	5
1. Comisiones	0149	0	1149	0
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	0	1150	0
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
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	10	1157	4
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-18	1158	-29
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-18	1160	-29
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	39.081	1162	45.791

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2021		Acumulado anterior 31/12/2020
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	204	1201	180	2201	671	3201	655
1.1 Activos titulizados	0202	204	1202	180	2202	671	3202	655
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-31	1204	-36	2204	-126	3204	-171
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-13	1205	-15	2205	-51	3205	-85
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-8	1206	-9	2206	-32	3206	-42
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-10	1207	-11	2207	-42	3207	-44
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-9	1208	-27	2208	-69	3208	-91
A) MARGEN DE INTERESES	0209	164	1209	117	2209	477	3209	394
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	-986	1217	-770	2217	-1.047	3217	-1.362
7.1 Servicios exteriores	0218	-6	1218	-2	2218	-27	3218	-48
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-6	1219	-2	2219	-27	3219	-48
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	-981	1224	-768	2224	-1.020	3224	-1.314
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-11	1225	-11	2225	-43	3225	-44
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	-9	3227	-9
7.3.4 Comisión variable	0228	-963	1228	-751	2228	-963	3228	-1.257
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-5	1230	-4	2230	-5	3230	-4
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-24	1231	8	2231	-24	3231	-51
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-24	1232	8	2232	-24	3232	-51
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	847	1234	645	2234	595	3234	1.024
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	847	1236	645	2236	595	3236	1.024
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	-5
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 PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2021		Acumulado anterior 31/12/2020
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	73	1300	-494	2300	-525	3300	-901
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	172	1301	123	2301	490	3301	408
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	212	1302	184	2302	690	3302	673
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-13	1303	-15	2303	-51	3303	-85
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	-9	1305	-27	2305	-73	3305	-91
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	-8	1307	-9	2307	-32	3307	-41
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-10	1308	-11	2308	-43	3308	-48
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-99	1309	-617	2309	-1.015	3309	-1.309
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-11	1310	-11	2310	-43	3310	-43
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-2	1312	-2	2312	-9	3312	-9
2.4 Comisión variable	0313	-86	1313	-604	2313	-963	3313	-1.257
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	574	1322	303	2322	996	3322	955
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	579	1325	305	2325	1.028	3325	1.008
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	1.075	1326	1.288	2326	4.393	3326	5.538
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	169	1327	550	2327	1.281	3327	1.420
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	662	1328	510	2328	1.470	3328	1.341
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	50
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-1.327	1331	-2.044	2331	-6.116	3331	-7.341
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-6	1332	-2	2332	-32	3332	-53
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	-6	1336	-2	2336	-32	3336	-53
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	646	1337	-191	2337	472	3337	54
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	7.488	1338	7.853	2338	7.662	3338	7.608
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	8.134	1339	7.662	2339	8.134	3339	7.662

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2021		Acumulado anterior 31/12/2020
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	5	1357	-27	2357	-58	3357	-91
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	5	1358	-27	2358	-58	3358	-91
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	9	1360	27	2360	69	3360	91
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	-15	1362	-1	2362	-10	3362	0
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

S.05.1

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2021								Situación cierre anual anterior 31/12/2020								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	19,83	0406	1,31	0426	0,00	0446	3,83	1386	18,48	1406	1,05	1426	0,00	1446	3,49	2386	0,00	2406	0,00	2426	0,00	2446	12,00
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: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK, 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	13	0467	6	0474	1	0481	0	0488	7	0495	797	0502	0	0509	804
De 1 a 3 meses	0461	1	0468	1	0475	0	0482	0	0489	1	0496	51	0503	0	0510	52
De 3 a 6 meses	0462	3	0469	9	0476	2	0483	1	0490	12	0497	262	0504	0	0511	274
De 6 a 9 meses	0463	0	0470	0	0477	0	0484	0	0491	0	0498	0	0505	0	0512	0
De 9 a 12 meses	0464	1	0471	5	0478	0	0485	0	0492	5	0499	28	0506	0	0513	33
Más de 12 meses	0465	72	0472	1.800	0479	48	0486	456	0493	2.304	0500	3.964	0507	0	0514	6.268
Total	0466	90	0473	1.821	0480	51	0487	457	0494	2.329	0501	5.102	0508	0	1515	7.431

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	13	0522	6	0529	1	0536	0	0543	7	0550	797	0557	0	0564	804	0571	3.675	0578	3.675	0584	21,88
De 1 a 3 meses	0516	1	0523	1	0530	0	0537	0	0544	1	0551	51	0558	0	0565	52	0572	168	0579	168	0585	30,71
De 3 a 6 meses	0517	3	0524	9	0531	2	0538	1	0545	12	0552	262	0559	0	0566	274	0573	1.120	0580	1.120	0586	24,47
De 6 a 9 meses	0518	0	0525	0	0532	0	0539	0	0546	0	0553	0	0560	0	0567	0	0574	0	0581	0	0587	0,00
De 9 a 12 meses	0519	1	0526	5	0533	0	0540	0	0547	5	0554	28	0561	0	0568	33	0575	1.187	0582	1.187	0588	2,76
Más de 12 meses	0520	57	0527	1.691	0534	47	0541	454	0548	2.192	0555	3.924	0562	0	0569	6.115	0576	19.519	0583	19.519	0589	31,33
Total	0521	75	0528	1.712	0535	50	0542	455	0549	2.216	0556	5.061	0563	0	0570	7.278	0577	25.668			0590	28,35

S.05.1

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 21/06/2007	
Inferior a 1 año	0600	1.514	1600	1.713	2600	6.916
Entre 1 y 2 años	0601	734	1601	1.604	2601	23.755
Entre 2 y 3 años	0602	1.491	1602	1.150	2602	40.088
Entre 3 y 4 años	0603	3.615	1603	2.224	2603	51.553
Entre 4 y 5 años	0604	2.862	1604	4.575	2604	28.222
Entre 5 y 10 años	0605	8.480	1605	11.370	2605	118.432
Superior a 10 años	0606	11.912	1606	15.165	2606	521.034
Total	0607	30.609	1607	37.801	2607	790.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	8,57	1608	8,84	2608	13,62

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 21/06/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,63	1609	15,69	2609	2,52

S.05.1
Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 21/06/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	445	0630	21.788	1620	524	1630	26.579	2620	1.070	2630	128.413
40% - 60%	0621	52	0631	6.168	1621	62	1631	7.558	2621	1.117	2631	195.087
60% - 80%	0622	12	0632	2.336	1622	18	1632	3.345	2622	1.328	2632	319.762
80% - 100%	0623	1	0633	167	1623	1	1633	167	2623	123	2633	24.681
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	1	2634	106
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	2	2635	400
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	1	2636	946
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	510	0638	30.459	1628	605	1638	37.650	2628	3.642	2638	669.395
Media ponderada (%)	0639	31,03	0649		1639	31,47	1649		2639	56,25	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 21/06/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	2,01	1650	2,14	2650	4,72
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,70	1651	4,70	2651	9,25
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,14	2652	2,29

S.05.1
Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 21/06/2007			
	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	2	2683	352
Aragón	0661	21	0684	606	1661	25	1684	950	2661	254	2684	31.637
Asturias	0662	0	0685	0	1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663	0	0686	0	1663	0	1686	0	2663	2	2686	540
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	232
Castilla La Mancha	0667	0	0690	0	1667	0	1690	0	2667	1	2690	39
Cataluña	0668	500	0691	29.659	1668	590	1691	36.499	2668	5.125	2691	741.773
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	56	1671	1	1694	59	2671	1	2694	92
Madrid	0672	0	0695	0	1672	0	1695	0	2672	28	2695	4.277
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	0	0697	0	1674	0	1697	0	2674	1	2697	40
Navarra	0675	0	0698	0	1675	0	1698	0	2675	2	2698	283
La Rioja	0676	0	0699	0	1676	0	1699	0	2676	0	2699	0
Comunidad Valenciana	0677	3	0700	288	1677	4	1700	292	2677	59	2700	10.702
País Vasco	0678	0	0701	0	1678	0	1701	0	2678	1	2701	34
Total España	0679	525	0702	30.609	1679	620	1702	37.801	2679	5.478	2702	790.000
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	525	0705	30.609	1682	620	1705	37.801	2682	5.478	2705	790.000

S.05.1
Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 21/06/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	16,95			1710	15,07			2710	6,27		
Sector	0711	38,58	0712	70	1711	37,95	1712	70	2711	36,27	2712	70

S.05.2

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			Situación inicial 21/06/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	Nominal unitario (€) 0721	0722	1720	Nominal unitario (€) 1721	1722	2720	Nominal unitario (€) 2721	2722			
ES0357326000	SERIE A	7.260	0	0	7.260	0	0	7.260	100.000	726.000			
ES0357326018	SERIE B	446	12.319	5.494	446	26.031	11.610	446	100.000	44.600			
ES0357326026	SERIE C	194	100.000	19.400	194	100.000	19.400	194	100.000	19.400			
Total		0723	7.900	0724	24.894	1723	7.900	1724	31.010	2723	7.900	2724	790.000

S.05.2

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2021

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
ES0357326000	SERIE A	NS	EURIBOR 3 m	0,19	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
ES0357326018	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,45	0,00	0	0	NO	5.494	0	0	5.494	0	0			
ES0357326026	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,80	0,21	0	0	NO	19.400	0	0	19.400	0	0			
Total						0740	0	0741	0	0743	24.894	0744	0	0745	24.894	0746	0

	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 21/06/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,18	0748	0,23	0749	4,38

S.05.2
Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/12/2021
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2021								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2020							
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								
ES0357326000	SERIE A	0	726.000	0	68.452	0	726.000	0	68.452	0	726.000	0	68.452	0	68.452		
ES0357326018	SERIE B	1.327	39.106	0	7.407	2.044	32.990	0	7.407	2.044	32.990	0	7.407	0	7.407		
ES0357326026	SERIE C	0	0	13	4.219	0	0	15	4.168	0	0	15	4.168	15	4.168		
Total		0754	1.327	0755	765.106	0756	13	0757	80.079	1754	2.044	1755	758.990	1756	15	1757	80.028

S.05.2

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2021

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 31/12/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 21/06/2007
				0762	0763	0764
ES0357326000	SERIE A	08/09/2015	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0357326000	SERIE A	23/01/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0357326018	SERIE B	08/03/2018	FCH	AAA	AAA	A
ES0357326018	SERIE B	24/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	A3
ES0357326026	SERIE C	01/09/2021	FCH	A	BBB	BBB
ES0357326026	SERIE C	09/09/2021	MDY	A1	B1	Baa3

S.05.2
Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/12/2021
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 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 21/06/2007	
Inferior a 1 año	0765	24.894	1765	31.010	2765	76.690
Entre 1 y 2 años	0766	0	1766	0	2766	75.728
Entre 2 y 3 años	0767	0	1767	0	2767	78.411
Entre 3 y 4 años	0768	0	1768	0	2768	56.711
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	0	2769	47.094
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	0	2770	190.311
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	265.055
Total	0772	24.894	1772	31.010	2772	790.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,24	1773	0,24	2773	17,76

S.05.3

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 21/06/2007	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	6.952	1775	6.952	2775	13.430
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	6.952	1776	6.952	2776	13.430
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	27,93	1777	22,42	2777	1,70
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		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	0,00	1792	0,00	2792	91,90
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: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

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 31/12/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 21/06/2007	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	JP MORGAN SECURITIES PLC	TRIMESTRAL	Media de los Euribor 12M publicado mensualmente por el BdE	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de los DC no Fallidas en base al periodo de revisión del tipo de interés (anual, semestral junto con trimestral y fijo)	Tipo de Referencia de los Bonos + Diferencial (-0,068% anual / 0,1% semestral junto con trimestral)	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de los DC no Fallidas en base al periodo de revisión del tipo de interés (anual, semestral junto con trimestral y fijo)	-10	-24		
Total							0808 -10	0809 -24	0810	

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

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 31/12/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 21/06/2007	Situación actual 31/12/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 21/06/2007		
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: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

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 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	503	7006	91	7009	2,05	7012	0,30	7015	2,03		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	503	7008	91	7011	2,05	7014	0,30	7017	2,03	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020		7021	6.988	7024	8.206	7027	22,20	7030	21,25	7033	23,38		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	6.988	7026	8.206	7029	22,20	7032	21,25	7035	23,38	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

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 - ES0357326026	4,90	77,93	73,99	4.9.2.2
SERIE C - ES0357326026	10,00	3,99	4,13	4.9.2.2
SERIE B - ES0357326018	1,25	2,05	2,03	4.9.2.2
SERIE B - ES0357326018	11,30	22,07	26,01	4.9.2.2
SERIE B - ES0357326018	10,00	3,99	4,13	4.9.2.2
SERIE C - ES0357326026	1,00	2,05	2,03	4.9.2.2
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0357326018	9,40	6,80	6,80	3.4.6.2.2.
SERIE C - ES0357326026	7,00	6,80	6,80	3.4.6.2.2.
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		27,93	26,51	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: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

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 los Derechos de Crédito en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,013	4862		5862	11	6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	Société Générale, 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 PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

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															

S.05.5

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo				Total
		29/03/2021	28/06/2021	28/09/2021	28/12/2021	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885					
Saldo inicial	0886	6.952	6.952	6.952	6.952	
Cobros del periodo	0887	1.736	1.879	2.243	1.462	
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-15	-28	-22	-19	
Pagos por derivados	0889	-28	-21	-15	-9	
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-6.952	-6.952	-6.952	-6.952	
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-1.507	-1.541	-1.780	-1.340	
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-8	-8	-8	-8	
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0	0	
Saldo disponible	0894	178	281	418	86	
Liquidación de comisión variable	0895	178	281	418	86	963

S.06

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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