

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: TDA PASTOR 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 4264
NIF Fondo: V83572081
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A-80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	42.822	1001	52.073
I. Activos financieros a largo plazo	0002	42.822	1002	52.073
1. Activos titulizados	0003	42.822	1003	52.073
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	41.119	1004	50.402
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	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	1.503	1014	1.503
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	201	1025	169
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	0
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	11.818	1041	13.166
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	7.802	1043	8.797
1. Activos titulizados	0044	6.874	1044	7.762
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	6.765	1045	7.660
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	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	3	1065	8
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	2	1066	2
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	104	1067	92
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	1	1068	1
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	0	1069	0
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	928	1074	1.035
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	928	1077	1.035
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	0
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	4.016	1085	4.369
1. Tesorería	0086	4.016	1086	4.369
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	54.641	1088	65.239

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	46.867	1089	56.222
I. Provisiones a largo plazo	0090	4.920	1090	4.946
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	4.920	1092	4.946
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	41.947	1094	51.277
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	39.969	1095	49.298
1.1 Series no subordinadas	0096	26.369	1096	35.698
1.2 Series subordinadas	0097	13.600	1097	13.600
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	1.978	1101	1.978
2.1 Préstamo subordinado	0102	1.978	1102	1.978
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

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) PASIVO CORRIENTE	0117	7.796	1117	9.326
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	7.790	1123	9.318
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	6.869	1124	7.753
1.1 Series no subordinadas	0125	6.869	1125	7.752
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	0	1128	1
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	71	1139	385
3.1 Derivados de cobertura	0140	71	1140	385
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	850	1143	1.180
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	850	1146	1.180
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	6	1148	8
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	6	1157	8
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-23	1158	-310
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-23	1160	-310
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	54.641	1162	65.239

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	178	1201	267	2201	843	3201	1.285
1.1 Activos titulizados	0202	178	1202	267	2202	843	3202	1.281
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	3
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-19	1204	-55	2204	-102	3204	-264
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-13	1205	-50	2205	-81	3205	-244
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-4	1206	-5	2206	-15	3206	-20
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-2	1207	0	2207	-5	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-84	1208	-108	2208	-389	3208	-562
A) MARGEN DE INTERESES	0209	76	1209	105	2209	352	3209	458
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	-346	1217	-105	2217	-378	3217	-458
7.1 Servicios exteriores	0218	-1	1218	-1	2218	-17	3218	-24
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	-1	2219	-17	3219	-24
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	-345	1224	-104	2224	-361	3224	-434
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-3	1225	-6	2225	-13	3225	-24
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	-8	3227	-9
7.3.4 Comisión variable	0228	-334	1228	-90	2228	-334	3228	-395
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-6	1230	-6	2230	-6	3230	-6
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	0	2231	0	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	0	2232	0	3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	271	1234	0	2234	26	3234	0
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	271	1236	0	2236	26	3236	0
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238	0	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	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: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-15	1300	-30	2300	6	3300	-357
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	73	1301	74	2301	361	3301	253
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	185	1302	238	2302	885	3302	1.136
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-13	1303	-45	2303	-87	3303	-256
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	-92	1305	-115	2305	-417	3305	-610
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	3
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-3	1307	-5	2307	-15	3307	-20
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-3	1308	0	2308	-5	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-88	1309	-103	2309	-355	3309	-610
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-3	1310	-6	2310	-13	3310	-24
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-2	1312	-2	2312	-8	3312	-9
2.4 Comisión variable	0313	-83	1313	-95	2313	-334	3313	-578
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	317	1322	-243	2322	-359	3322	35
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	428	1325	-249	2325	-8	3325	55
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	1.676	1326	1.174	2326	7.350	3326	8.578
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	933	1327	850	2327	2.554	3327	2.878
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	127	1328	81	2328	300	3328	473
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-2.308	1331	-2.354	2331	-10.212	3331	-11.873
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-111	1332	6	2332	-350	3332	-21
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	10	2333	0	3333	10
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	-111	1336	-4	2336	-350	3336	-30
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	302	1337	-273	2337	-353	3337	-322
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	3.714	1338	4.642	2338	4.369	3338	4.691
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	4.016	1339	4.369	2339	4.016	3339	4.369

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	222	1357	-32	2357	-102	3357	136
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	222	1358	-32	2358	-102	3358	136
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	84	1360	108	2360	389	3360	562
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	-306	1362	-75	2362	-287	3362	-698
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO POPULAR ESPAÑOL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2016								Situación cierre anual anterior 31/12/2015								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380	0,63	0400	0,01	0420	0,00	0440	5,00	1380	0,45	1400	0,01	1420	0,00	1440	4,67	2380	0,00	2400	0,00	2420	0,00	2440	10,00
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		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	0,00	0410	0,00	0430	0,00	0450	0,00	1390	0,00	1410	0,00	1430	0,00	1450	0,00	2390	0,00	2410	0,00	2430	0,00	2450	10,00
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	

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO POPULAR ESPAÑOL

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	32	0467	12	0474	2	0481	0	0488	14	0495	1.238	0502	0	0509	1.252
De 1 a 3 meses	0461	6	0468	1	0475	0	0482	0	0489	2	0496	188	0503	0	0510	189
De 3 a 6 meses	0462	1	0469	0	0476	0	0483	0	0490	0	0497	15	0504	0	0511	15
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	2	0477	0	0484	0	0491	2	0498	1	0505	0	0512	3
De 9 a 12 meses	0464	0	0471	0	0478	0	0485	0	0492	0	0499	0	0506	0	0513	0
Más de 12 meses	0465	6	0472	80	0479	1	0486	3	0493	85	0500	206	0507	0	0514	291
Total	0466	46	0473	96	0480	3	0487	3	0494	103	0501	1.647	0508	0	1515	1.750

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	32	0522	12	0529	2	0536	0	0543	14	0550	1.238	0557	0	0564	1.252	0571	4.591	0578	4.591	0584	27,26
De 1 a 3 meses	0516	6	0523	1	0530	0	0537	0	0544	2	0551	188	0558	0	0565	189	0572	893	0579	893	0585	21,20
De 3 a 6 meses	0517	1	0524	0	0531	0	0538	0	0545	0	0552	15	0559	0	0566	15	0573	85	0580	85	0586	17,78
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	2	0532	0	0539	0	0546	2	0553	1	0560	0	0567	3	0574	128	0581	128	0587	2,20
De 9 a 12 meses	0519	0	0526	0	0533	0	0540	0	0547	0	0554	0	0561	0	0568	0	0575	0	0582	0	0588	0,00
Más de 12 meses	0520	6	0527	80	0534	1	0541	3	0548	85	0555	206	0562	0	0569	291	0576	735	0583	735	0589	39,58
Total	0521	46	0528	96	0535	3	0542	3	0549	103	0556	1.647	0563	0	0570	1.750	0577	6.432			0590	27,21

S.05.1

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO POPULAR ESPAÑOL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 24/02/2003	
Inferior a 1 año	0600	1.793	1600	2.247	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	482	1601	315	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	674	1602	733	2602	25
Entre 3 y 4 años	0603	4.340	1603	990	2603	219
Entre 4 y 5 años	0604	4.772	1604	6.002	2604	733
Entre 5 y 10 años	0605	31.879	1605	25.287	2605	27.013
Superior a 10 años	0606	5.751	1606	24.251	2606	459.596
Total	0607	49.691	1607	59.825	2607	487.586
Vida residual media ponderada (años)	0608	8,03	1608	8,83	2608	20,98

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 24/02/2003	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	21,13	1609	18,95	2609	1,94

TDA PASTOR 1, FTA

S.05.1

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO POPULAR ESPAÑOL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 24/02/2003			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.601	0630	45.141	1620	1.666	1630	47.493	2620	1.074	2630	57.802
40% - 60%	0621	55	0631	3.047	1621	232	1631	10.829	2621	1.806	2631	137.507
60% - 80%	0622	0	0632	0	1622	0	1632	0	2622	3.324	2632	285.705
80% - 100%	0623	0	0633	0	1623	0	1633	0	2623	0	2633	0
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	1.656	0638	48.188	1628	1.898	1638	58.322	2628	6.204	2638	481.014
Media ponderada (%)			0639	26,94			1639	29,26			2639	60,63

S.05.1

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO POPULAR ESPAÑOL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 24/02/2003	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,36	1650	1,72	2650	4,38
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,00	1651	4,46	2651	6,63
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	0,00

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO POPULAR ESPAÑOL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 24/02/2003			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	121	0683	3.093	1660	143	1683	3.832	2660	550	2683	39.335
Aragón	0661	32	0684	1.003	1661	38	1684	1.159	2661	130	2684	9.433
Asturias	0662	127	0685	3.022	1662	139	1685	3.585	2662	399	2685	24.469
Baleares	0663	22	0686	788	1663	24	1686	957	2663	70	2686	6.229
Canarias	0664	39	0687	1.312	1664	48	1687	1.604	2664	146	2687	11.516
Cantabria	0665	12	0688	373	1665	14	1688	439	2665	63	2688	5.318
Castilla-León	0666	97	0689	2.379	1666	113	1689	2.878	2666	338	2689	22.228
Castilla La Mancha	0667	14	0690	477	1667	18	1690	589	2667	54	2690	4.236
Cataluña	0668	287	0691	9.534	1668	326	1691	11.558	2668	1.129	2691	97.627
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670	5	0693	72	1670	5	1693	88	2670	12	2693	882
Galicia	0671	491	0694	12.673	1671	553	1694	14.690	2671	1.614	2694	103.525
Madrid	0672	291	0695	11.687	1672	339	1695	14.184	2672	1.201	2695	124.622
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	1	2696	89
Murcia	0674	12	0697	358	1674	16	1697	511	2674	68	2697	4.136
Navarra	0675	3	0698	132	1675	3	1698	154	2675	11	2698	1.297
La Rioja	0676	0	0699	0	1676	1	1699	1	2676	12	2699	945
Comunidad Valenciana	0677	61	0700	1.472	1677	71	1700	1.946	2677	258	2700	18.201
País Vasco	0678	43	0701	1.315	1678	48	1701	1.651	2678	150	2701	13.501
Total España	0679	1.657	0702	49.691	1679	1.899	1702	59.825	2679	6.206	2702	487.586
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	1.657	0705	49.691	1682	1.899	1705	59.825	2682	6.206	2705	487.586

TDA PASTOR 1, FTA

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 24/02/2003			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	3,30			1710	3,01			2710	0,92		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

TDA PASTOR 1, FTA

S.05.2

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016			Situación cierre anual anterior 31/12/2015			Situación inicial 24/02/2003					
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			
ES0377980000	Serie A1	4.298	0	0	4.298	0	0	4.298	100.000	429.800			
ES0377980018	Serie A2	475	69.974	33.238	475	91.473	43.450	475	100.000	47.500			
ES0377980026	Serie B	106	100.000	10.600	106	100.000	10.600	106	100.000	10.600			
ES0377980034	Serie C	30	100.000	3.000	30	100.000	3.000	30	100.000	3.000			
ES0377980042	Serie D	37	0	0	37	0	0	37	100.000	3.700			
ES0377980059	Valor IO	475	0	0	475	0	0	475	8.753	4.158			
Total		0723	5.421	0724	46.838	1723	5.421	1724	57.050	2723	5.421	2724	498.758

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		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
ES0377980000	Serie A1	NS	EURIBOR 3 m	0,26	0,00	0	0	SI	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0377980018	Serie A2	NS	EURIBOR 3 m	0,28	0,00	0	0	SI	33.238	0	0	33.238	0	0	0	0	
ES0377980026	Serie B	S	EURIBOR 3 m	0,55	0,23	0	0	SI	10.600	0	0	10.600	0	0	0	0	
ES0377980034	Serie C	S	EURIBOR 3 m	1,15	0,83	0	0	SI	3.000	0	0	3.000	0	0	0	0	
ES0377980042	Serie D	S	EURIBOR 3 m	3,80	0,00	0	0	SI	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0377980059	Valor IO	NS	3% del SNP Bono A2	0,00	0,00	0	0	SI	0	0	0	0	0	0	0	0	
Total						0740	0	0741	0	0743	46.838	0744	0	0745	46.838	0746	0

	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 24/02/2003	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,12	0748	0,36	0749	2,87

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

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2015							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0377980000	Serie A1	0	429.800	0	51.168	0	429.800	0	51.168	0	429.800	0	51.168	0	51.168		
ES0377980018	Serie A2	2.308	14.262	0	12.826	2.354	4.050	28	12.805	2.354	4.050	28	12.805	28	12.805		
ES0377980026	Serie B	0	0	7	3.264	0	0	14	3.230	0	0	14	3.230	14	3.230		
ES0377980034	Serie C	0	0	6	1.176	0	0	8	1.149	0	0	8	1.149	8	1.149		
ES0377980042	Serie D	0	3.700	0	986	0	3.700	0	986	0	3.700	0	986	0	986		
ES0377980059	Valor IO	0	4.158	0	248	0	4.158	0	248	0	4.158	0	248	0	248		
Total		0754	2.308	0755	451.920	0756	13	0757	69.669	1754	2.354	1755	441.708	1756	50	1757	69.587

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 24/02/2003
				0762	0763	0764
ES0377980000	Serie A1	19/08/2014	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0377980000	Serie A1	13/02/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0377980018	Serie A2	19/08/2014	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0377980018	Serie A2	13/02/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0377980026	Serie B	14/07/2015	FCH	A+	A+	A
ES0377980026	Serie B	10/07/2015	MDY	Aa2	Aa2	A2
ES0377980034	Serie C	14/07/2015	FCH	BBB+	BBB+	BBB
ES0377980034	Serie C	14/05/2016	MDY	Aa3	Baa1	Baa2
ES0377980042	Serie D	25/02/2003	FCH	BB	BB	BB
ES0377980042	Serie D	25/02/2003	MDY	Ba1	Ba1	Ba1
ES0377980059	Valor IO	25/02/2003	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0377980059	Valor IO	25/02/2003	MDY	Aaa	Aaa	Aaa

TDA PASTOR 1, FTA

S.05.2

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 24/02/2003	
Inferior a 1 año	0765	46.838	1765	7.867	2765	26.482
Entre 1 y 2 años	0766	0	1766	49.183	2766	20.253
Entre 2 y 3 años	0767	0	1767	0	2767	22.362
Entre 3 y 4 años	0768	0	1768	0	2768	22.864
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	0	2769	23.035
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	0	2770	119.364
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	264.399
Total	0772	46.838	1772	57.050	2772	498.758
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,24	1773	1,49	2773	19,87

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 24/02/2003	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	2.473	1775	2.473	2775	3.957
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	2.473	1776	2.473	2776	3.957
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	5,28	1777	4,33	2777	0,79
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Banco Popular	1778	Banco Popular	2778	Banco Pastor
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	70,96	1792	76,16	2792	96,53
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	

TDA PASTOR 1, FTA

S.05.3

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 24/02/2003	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap Préstamo a Préstamo	CECABANK	TRIMESTRAL	Tipo interés de la cartera	Ver Nota S.06	Tipo Referencia de los Bonos + 0,90%	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de los préstamo sin impago al inicio del periodo	-71	-385		
Total							0808 -71	0809 -385	0810	

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)			Valor en libros (miles de euros)			Otras características	
	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 24/02/2003	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 24/02/2003		
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: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	18	7006	89	7009	0,04	7012	0,15	7015	0,06		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	18	7008	89	7011	0,04	7014	0,15	7017	0,06	7018	II.11.2.1
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	408	7024	419	7027	0,82	7030	0,70	7033	0,92		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	408	7026	419	7029	0,82	7032	0,70	7035	0,92	7036	Apartado III.5.2

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Serie A2 - ES0377980018	6,00	0,04	0,06	Apartado II.11.2.1
Serie A1 - ES0377980000	6,00	0,04	0,06	Apartado II.11.2.1
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Serie C - ES0377980034	5,50	0,63	0,59	Apartado V.4.2.
Serie D - ES0377980042	3,40	0,63	0,59	Apartado V.4.2.
Serie B - ES0377980026	6,50	0,63	0,59	Apartado V.4.2.
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		5,28	5,03	Apartado V.3.2.
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: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862		2862	Saldo Nominal pendiente de los Derechos de Crédito en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,026	4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	Société Générale, Sucursal en España	1864	2	2864	Saldo Nominal pendiente de los Derechos de Crédito en cada Fecha de Pago	3864	0,003	4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Banco Popular
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.6.5.

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															

TDA PASTOR 1, FTA

S.05.5

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo				Total
		29/03/2016	28/06/2016	28/09/2016	28/12/2016	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885					
Saldo inicial	0886	2.582	2.591	2.782	2.496	
Cobros del periodo	0887	3.241	2.759	2.509	2.703	
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-15	-13	-7	-7	
Pagos por derivados	0889	-113	-111	-100	-92	
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-2.473	-2.473	-2.473	-2.473	
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-2.993	-2.351	-2.629	-2.321	
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-4	-4	-4	-3	
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0	0	
Saldo disponible	0894	225	397	79	303	
Liquidación de comisión variable	0895	107	88	55	83	334

Denominación Fondo: TDA PASTOR 1, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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