

**TDA 24 - Fondo de Titulización de Activos**  
**LIQUIDACION DEL PERIODO 22/06/22 - 22/09/22**

|  | Euros               |
|--|---------------------|
|  | TOTAL               |
| <b>I. Situación Inicial</b>                          | <b>1,54</b>         |
| Fondo Reserva  | 0,00                |
| Saldo Inicial Cuenta Tesorería                       | 1,54                |
| <b>II. Fondos recibidos del emisor</b>               | <b>2.723.262,36</b> |
| <b>Principal:</b>                                    |                     |
| Según calendario hasta 31/08/22:                     | 1.879.543,65        |
| Amort. Anticipada hasta 31/08/22:                    | 513.847,67          |
| <b>Intereses:</b>                                    | <b>-111.365,26</b>  |
| <b>Ingresos por venta de inmuebles</b>               | <b>441.236,30</b>   |
| <b>III. Subtotal Recursos Disponibles ( I + II):</b> | <b>2.723.263,90</b> |
| <b>IV. Total intereses de la reinversión:</b>        | <b>-2.412,83</b>    |
| Intereses de la Cta. De Tesorería                    | -1.033,88           |
| Intereses de la Cta. De Cobros                       | -1.378,95           |
| Intereses de la Cta. De Amortización Línea Liquidez  | 0,00                |
| <b>V. Recursos disponibles ( III + IV ):</b>         | <b>2.720.851,07</b> |
| <b>VI. Varios:</b>                                   | <b>179.488,90</b>   |
| <b>VII. Liquidación SWAP:</b>                        | <b>-263.589,08</b>  |
| Cantidad a Pagar por la Parte A ( J P Morgan):       | -19.444,89          |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):             | 244.144,19          |
| <b>VIII. Línea Liquidez</b>                          | <b>0,00</b>         |
| Intereses  | 0,00                |
| Amortización   | 0,00                |
| <b>IX. Pago a los Bonos:</b>                         | <b>2.277.763,70</b> |
| <b>Bonos A2:</b>                                     |                     |
| Intereses correspondientes al 22/09/22:              | 261,90              |
| Retenciones practicadas a los bonos:                 | 49,76               |
| Amortización correspondiente al 22/09/22:            | 2.277.501,80        |
| <b>Bonos B:</b>                                      |                     |
| Intereses correspondientes al 22/09/22:              | 5.934,60            |
| Intereses pagados a 22/09/22:                        | 0,00                |
| Retenciones practicadas a los bonos:                 | 0,00                |
| Intereses impagados a 22/09/22:                      | 291.598,65          |
| Amortización correspondiente al 22/09/22:            | 0,00                |
| <b>Bonos C:</b>                                      |                     |
| Intereses vencidos a 22/09/22:                       | 8.735,04            |
| Intereses pagados a 22/09/22:                        | 0,00                |
| Retenciones practicadas a los bonos:                 | 0,00                |
| Intereses impagados a 22/09/22:                      | 513.801,63          |
| Amortización correspondiente al 22/09/22:            | 0,00                |
| <b>Bonos D:</b>                                      |                     |
| Intereses vencidos a 22/09/22:                       | 23.281,00           |
| Intereses pagados a 22/09/22:                        | 0,00                |
| Retenciones practicadas a los bonos:                 | 0,00                |
| Intereses impagados a 22/09/22:                      | 1.230.981,50        |
| Amortización correspondiente al 22/09/22:            | 0,00                |
| <b>Reinversión o devolución de las retenciones:</b>  | <b>-49,76</b>       |
| <b>X. Saldo disponible :</b>                         | <b>9,39</b>         |
| <b>Distribución del saldo disponible:</b>            |                     |
| Fondo de Reserva previo 22/06/22:                    | 0,00                |
| Aportación al Fondo de Reserva                       | 0,00                |
| Cantidad Dotada Línea Liquidez 22/09/22              | 0,00                |
| Recursos para proximo pago                           | 9,39                |
| <b>Margen de Intermediación Financiera</b>           | <b>0,00</b>         |
| <b>Fondo de Reserva 22/09/22:</b>                    | <b>0,00</b>         |

Destinatarios: AIAF; CNMV



**Nº: 3512/22**  
Titulización de Activos, SGFT,S.A.  
Orense, 58  
28020 Madrid  
Tel.:917020808  
http://www.tda-sgft.com  
TDA24liq.trimSep22

## Fondo de Titulización de Activos

## INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 22 de Septiembre de 2022

Importes en euros

| I. BONOS A2 ES0377952017                                  | Sobre 970 bonos | Por Bono     |
|---|-----------------|--------------|
| 1. Saldo inicial (01/12/05):                              | 97.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 51.743.340,50 € | 53.343,65 €  |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:  | 261,90 €        | 0,27 €       |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:   | 2.277.501,80 €  | 2.347,94 €   |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:      | 49.465.838,70 € | 50.995,71 €  |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento:                   | 50,995710%      | 50,995710%   |

| II. BONOS B ES0377952025                                  | Sobre 135 bonos | Por Bono     |
|---|-----------------|--------------|
| 1. Saldo inicial (01/12/05):                              | 13.500.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 13.500.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:            | 5.934,60 €      | 43,96 €      |
| 4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:               | 0,00 €          | 0,00 €       |
| 5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:           | 291.598,65 €    | 2.159,99 €   |
| 6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:   | 0,00 €          | 0,00 €       |
| 7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:      | 13.500.000,00 € | 100.000,00 € |
| 8. Porcentaje pendiente de vencimiento:                   | 100,000000%     | 100,000000%  |

| III. BONOS C ES0377952033                                 | Sobre 81 bonos | Por Bono     |
|---|----------------|--------------|
| 1. Saldo inicial (01/12/05):                              | 8.100.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 8.100.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:            | 8.735,04 €     | 107,84 €     |
| 4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:               | 0,00 €         | 0,00 €       |
| 5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:           | 513.801,63 €   | 6.343,23 €   |
| 6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:   | 0,00 €         | 0,00 €       |
| 7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:      | 8.100.000,00 € | 100.000,00 € |
| 8. Porcentaje pendiente de vencimiento:                   | 100,000000%    | 100,000000%  |

| IV. BONOS D ES0377952041                                  | Sobre 50 bonos | Por Bono     |
|---|----------------|--------------|
| 1. Saldo inicial (01/12/05):                              | 5.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 5.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:            | 23.281,00 €    | 465,62 €     |
| 4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:               | 0,00 €         | 0,00 €       |
| 5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:           | 1.230.981,50 € | 24.619,63 €  |
| 6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:   | 0,00 €         | 0,00 €       |
| 7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:      | 5.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 8. Porcentaje pendiente de vencimiento:                   | 100,000000%    | 100,000000%  |

| V. EL FONDO  | Importes en euros |
|--|-------------------|
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/08/22:                               |                   |
| a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | 44.681.090,10 €   |
| b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas:    | 20.137.702,35 €   |
| c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas:       | 44.707.742,27 €   |
| d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas:          | 34.336.423,93 €   |
| 2. Amortización del período 31/05/22 a 31/08/22:                                   | 2.393.391,32 €    |
| a) Según calendario:   | 1.879.543,65 €    |
| b) Amortización anticipada hasta 31/08/22:   | 513.847,67 €      |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):                                   |                   |
| a) Último año:   | 5,02%             |
| b) Último semestre:  | 4,96%             |
| c) Último trimestre:   | 4,32%             |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:   | 0,56%             |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:  | 0,06%             |
| 6. Porcentaje de fallidos (1):   | 43,44%            |
| 7. Nivel de Impago (2)   | 0,28%             |

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 12 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de las Participaciones Hipotecarias con morosidad superior a 90 días en la Fecha de Cobro inmediata anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

Destinatarios: Cedentes; CNMV; AIAF,



Nº: 3513/22

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

<http://www.tda-sgft.com>

TDA24\Info\inver.trim\Sep22

**TDA 24 , FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

**INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 22/06/22-22/09/22**

**I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO**

|   |   |
|---|---|
| Fecha de Constitución del Fondo   | 28 de noviembre de 2005   |
| Fecha Emisión Bonos   | 28 de noviembre de 2005   |
| Fecha Final Amortización Bonos (5,02% TAA)                                      | 23 de marzo de 2026   |
| Sociedad Gestora  | Titulización de Activos, SGFT,S.A.  |
| Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca | Credifimo, CaixaBank (Bankpime), Liberbank (Banco Castilla la Mancha)               |
| Agente de Pagos   | BNP PARIBAS   |
| Negociación Mercado   | Mercado AIAF  |
| Agencia de Calificación   | Fitch Ibca  |
| Calificación  | Bono A2:(F) CCC (sf)<br>Bono B:(F) C (sf)<br>Bono C:(F) C (sf)<br>Bono D:(F) C (sf) |

## II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Nombre                                    | Bonos de Titulización TDA 24 |
|---|------------------------------|
| <b>Serie A2:</b>                          |                              |
| Código ISIN                               | ES0377952017                 |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 97.000.000,00 Euros          |
| Nominal en circulación total (actual)     | 49.465.838,70 Euros          |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros             |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 50.995,71 Euros              |
| <b>Serie B:</b>                           |                              |
| Código ISIN                               | ES0377952025                 |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 13.500.000,00 Euros          |
| Nominal en circulación total (actual)     | 13.500.000,00 Euros          |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros             |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 100.000,00 Euros             |
| <b>Serie C:</b>                           |                              |
| Código ISIN                               | ES0377952033                 |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 8.100.000,00 Euros           |
| Nominal en circulación total (actual)     | 8.100.000,00 Euros           |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros             |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 100.000,00 Euros             |
| <b>Serie D:</b>                           |                              |
| Código ISIN                               | ES0377952041                 |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 5.000.000,00 Euros           |
| Nominal en circulación total (actual)     | 5.000.000,00 Euros           |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros             |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 100.000,00 Euros             |

## III. INFORMACION INCLUIDA

\* Liquidación del Período: 22/06/22-22/09/22

\* Flujos de Caja del Período: 22/06/22-22/09/22

\* Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Septiembre de 2022

**TDA 24****Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/06/22 - 22/09/22**

| <b>I. INVERSIONES/FINANCIACIONES</b> | <b>Euros</b>        |                     |
|--------------------------------------|---------------------|---------------------|
|                                      | <u>Ingresos</u>     | <u>Pagos</u>        |
| Amortización Bonos Titulización Hip. |                     | 2.277.501,80        |
| Amortización Participaciones Hip.    | 2.393.391,32        |                     |
| Ingresos por venta de inmuebles      | 441.236,30          |                     |
| <b>II. INTERESES</b>                 |                     |                     |
| Intereses pagados línea de liquidez  |                     | 0,00                |
| Intereses pagados a los BTH          |                     | 261,90              |
| Intereses recibidos de las PHs       | -111.365,26         |                     |
| Intereses Inversiones Temporales     | -2.412,83           |                     |
| <b>III. GASTOS</b>                   |                     |                     |
| Comisiones Periódicas:               |                     | 179.488,90          |
| Neto SWAP                            |                     | 263.589,08          |
| Margen de Intermediación Financiera  |                     | 0,00                |
| <b>Total Ingresos/Pagos</b>          | <b>2.720.849,53</b> | <b>2.720.841,68</b> |
| Saldo inicial 22/06/22               | 1,54                |                     |
| A Inversiones Temporales             |                     | 9,39                |
| <b>Total</b>                         | <b>2.720.851,07</b> | <b>2.720.851,07</b> |
| Retenciones practicadas el 22/09/22  | 49,76               |                     |
| A Inversiones Temporales             |                     | 49,76               |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 3519/22**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

<http://www.tda-sgft.com>

TDA 24\fluj.trim\Sep22