

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: 31/12/2020

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: 31/12/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2020		Periodo anterior 31/12/2019
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	29.423	1001	36.556
I. Activos financieros a largo plazo	0002	29.423	1002	36.556
1. Activos titulizados	0003	29.423	1003	36.556
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	25.926	1010	32.030
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	3.518	1025	4.546
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-21	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: 31/12/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	16.369	1041	17.604
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	469	1042	428
V. Activos financieros a corto plazo	0043	8.238	1043	9.568
1. Activos titulizados	0044	8.228	1044	9.552
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	4.888	1051	6.116
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	24	1065	32
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	3	1066	6
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	3.469	1067	3.556
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	59	1068	67
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-216	1069	-224
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	9	1074	16
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	9	1077	16
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	7.662	1085	7.608
1. Tesorería	0086	7.662	1086	7.608
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	45.791	1088	54.160

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: 31/12/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2020		Periodo anterior 31/12/2019
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	37.432	1089	44.484
I. Provisiones a largo plazo	0090	7.827	1090	8.852
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	7.827	1092	8.852
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	29.605	1094	35.632
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	22.653	1095	28.680
1.1 Series no subordinadas	0096	0	1096	0
1.2 Series subordinadas	0097	22.653	1097	28.680
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: 31/12/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) PASIVO CORRIENTE	0117	8.388	1117	9.705
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	8.383	1123	9.697
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	8.358	1124	9.672
1.1 Series no subordinadas	0125	0	1125	0
1.2 Series subordinadas	0126	8.357	1126	9.671
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	24	1139	24
3.1 Derivados de cobertura	0140	24	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	5	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	4	1157	8
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-29	1158	-29
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-29	1160	-29
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	45.791	1162	54.160

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: 31/12/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2020		Acumulado anterior 31/12/2019
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	180	1201	219	2201	655	3201	993
1.1 Activos titulizados	0202	180	1202	219	2202	655	3202	993
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-36	1204	-44	2204	-171	3204	-207
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-15	1205	-21	2205	-85	3205	-119
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-9	1206	-10	2206	-42	3206	-46
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-11	1207	-12	2207	-44	3207	-42
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-27	1208	-34	2208	-91	3208	-115
A) MARGEN DE INTERESES	0209	117	1209	142	2209	394	3209	672
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	-770	1217	-253	2217	-1.362	3217	-2.367
7.1 Servicios exteriores	0218	-2	1218	-4	2218	-48	3218	-45
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-2	1219	-4	2219	-48	3219	-45
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	-768	1224	-250	2224	-1.314	3224	-2.322
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-11	1225	-11	2225	-44	3225	-43
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	-751	1228	-232	2228	-1.257	3228	-2.266
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-4	1230	-4	2230	-4	3230	-4
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	8	1231	-102	2231	-51	3231	-127
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	8	1232	-102	2232	-51	3232	-127
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	645	1234	214	2234	1.024	3234	1.823
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	645	1236	214	2236	1.024	3236	1.823
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	-5	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	0	2239	0	3239	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2020		Acumulado anterior 31/12/2019
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-494	1300	-99	2300	-901	3300	-1.626
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	123	1301	146	2301	408	3301	692
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	184	1302	225	2302	673	3302	1.013
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-15	1303	-21	2303	-85	3303	-119
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	-27	1305	-34	2305	-91	3305	-114
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-9	1307	-10	2307	-41	3307	-47
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-11	1308	-13	2308	-48	3308	-41
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-617	1309	-245	2309	-1.309	3309	-2.318
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	-604	1313	-232	2313	-1.257	3313	-2.266
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	303	1322	-289	2322	955	3322	463
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	305	1325	-285	2325	1.008	3325	513
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	1.288	1326	1.557	2326	5.538	3326	6.790
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	550	1327	606	2327	1.420	3327	3.334
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	510	1328	174	2328	1.341	3328	1.996
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	50	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-2.044	1331	-2.621	2331	-7.341	3331	-11.608
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-2	1332	-4	2332	-53	3332	-50
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	-2	1336	-4	2336	-53	3336	-50
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-191	1337	-388	2337	54	3337	-1.163
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	7.853	1338	7.996	2338	7.608	3338	8.771
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	7.662	1339	7.608	2339	7.662	3339	7.608

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: 31/12/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2020		Acumulado anterior 31/12/2019
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	-27	1357	-35	2357	-91	3357	-115
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-27	1358	-35	2358	-91	3358	-115
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	27	1360	34	2360	91	3360	115
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	-1	1362	2	2362	0	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: 31/12/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2020								Situación cierre anual anterior 31/12/2019								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	18,48	0406	1,05	0426	0,00	0446	3,49	1386	17,52	1406	0,74	1426	0,00	1446	6,40	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: 31/12/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	26	0467	22	0474	2	0481	0	0488	24	0495	1.985	0502	0	0509	2.008
De 1 a 3 meses	0461	5	0468	5	0475	1	0482	0	0489	6	0496	484	0503	0	0510	490
De 3 a 6 meses	0462	0	0469	0	0476	0	0483	0	0490	0	0497	0	0504	0	0511	0
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	2	0477	0	0484	0	0491	2	0498	6	0505	0	0512	8
De 9 a 12 meses	0464	1	0471	1	0478	0	0485	0	0492	1	0499	0	0506	0	0513	1
Más de 12 meses	0465	83	0472	2.337	0479	59	0486	540	0493	2.936	0500	4.640	0507	0	0514	7.576
Total	0466	116	0473	2.366	0480	63	0487	540	0494	2.968	0501	7.115	0508	0	1515	10.083

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	26	0522	22	0529	2	0536	0	0543	24	0550	1.985	0557	0	0564	2.008	0571	13.413	0578	13.413	0584	14,97
De 1 a 3 meses	0516	5	0523	5	0530	1	0537	0	0544	6	0551	484	0558	0	0565	490	0572	1.387	0579	1.387	0585	35,34
De 3 a 6 meses	0517	0	0524	0	0531	0	0538	0	0545	0	0552	0	0559	0	0566	0	0573	0	0580	0	0586	0,00
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	2	0532	0	0539	0	0546	2	0553	6	0560	0	0567	8	0574	71	0581	71	0587	11,55
De 9 a 12 meses	0519	1	0526	1	0533	0	0540	0	0547	1	0554	0	0561	0	0568	1	0575	176	0582	176	0588	0,46
Más de 12 meses	0520	68	0527	2.227	0534	58	0541	537	0548	2.822	0555	4.600	0562	0	0569	7.422	0576	26.676	0583	26.676	0589	27,82
Total	0521	101	0528	2.256	0535	62	0542	537	0549	2.855	0556	7.074	0563	0	0570	9.929	0577	41.723			0590	23,80

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: 31/12/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 21/06/2007	
Inferior a 1 año	0600	1.713	1600	1.984	2600	6.916
Entre 1 y 2 años	0601	1.604	1601	1.376	2601	23.755
Entre 2 y 3 años	0602	1.150	1602	2.374	2602	40.088
Entre 3 y 4 años	0603	2.224	1603	1.811	2603	51.553
Entre 4 y 5 años	0604	4.575	1604	2.846	2604	28.222
Entre 5 y 10 años	0605	11.370	1605	16.513	2605	118.432
Superior a 10 años	0606	15.165	1606	19.343	2606	521.034
Total	0607	37.801	1607	46.248	2607	790.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	8,84	1608	9,28	2608	13,62

Antigüedad	Situación actual 31/12/2020					
	Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 21/06/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	15,69	1609	14,75	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: 31/12/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				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	524	0630	26.579	1620	625	1630	31.226	2620	1.070	2630	128.413
40% - 60%	0621	62	0631	7.558	1621	92	1631	11.058	2621	1.117	2631	195.087
60% - 80%	0622	18	0632	3.345	1622	20	1632	3.638	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	605	0638	37.650	1628	738	1638	46.089	2628	3.642	2638	669.395
Media ponderada (%)	0639	31,47	0649		1639	32,27	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: 31/12/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 21/06/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	2,14	1650	2,27	2650	4,72
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,70	1651	4,70	2651	9,25
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,14	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: 31/12/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				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	25	0684	950	1661	31	1684	1.260	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	590	0691	36.499	1668	714	1691	44.599	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	59	1671	1	1694	62	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	4	0700	292	1677	8	1700	327	2677	59	2700	10.702
País Vasco	0678	0	0701	0	1678	0	1701	0	2678	1	2701	34
Total España	0679	620	0702	37.801	1679	754	1702	46.248	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	620	0705	37.801	1682	754	1705	46.248	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: 31/12/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 21/06/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	15,07			1710	13,34			2710	6,27		
Sector	0711	37,95	0712	70	1711	37,88	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: 31/12/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			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	26.031	11.610	446	42.492	18.951	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	31.010	1723	7.900	1724	38.351	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: 31/12/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado	Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas					
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736			0737	0738	0739		
ES0357326000	SERIE A	NS	EURIBOR 3 m	0,19	0,00	0	0	NO	0	0	0	0					
ES0357326018	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,45	0,00	0	0	NO	11.610	0	11.610	0					
ES0357326026	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,80	0,26	0	0	NO	19.400	0	19.400	0					
Total						0740	0	0741	0	0743	31.010	0744	0	0745	31.010	0746	0

	Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 21/06/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,23	0748	0,26	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: 31/12/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2020								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2019							
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	2.044	32.990	0	7.407	2.621	25.649	2	7.398	2.621	25.649	2	7.398	2	7.398		
ES0357326026	SERIE C	0	0	15	4.168	0	0	19	4.092	0	0	19	4.092	19	4.092		
Total		0754	2.044	0755	758.990	0756	15	0757	80.028	1754	2.621	1755	751.649	1756	21	1757	79.942

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: 31/12/2020

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 31/12/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	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	08/03/2018	FCH	BBB	BBB	BBB
ES0357326026	SERIE C	19/03/2018	MDY	B1	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: 31/12/2020

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 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 21/06/2007	
Inferior a 1 año	0765	31.010	1765	38.351	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	31.010	1772	38.351	2772	790.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,24	1773	0,50	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: 31/12/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		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	22,42	1777	18,13	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: 31/12/2020

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 31/12/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	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)	-24	-24		
Total							0808 -24	0809 -24	0810	

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: 31/12/2020

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 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 21/06/2007		Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		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: 31/12/2020

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 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	91	7006	304	7009	0,30	7012	0,80	7015	0,29		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	91	7008	304	7011	0,30	7014	0,80	7017	0,29	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020		7021	8.206	7024	9.169	7027	21,25	7030	19,51	7033	20,98		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	8.206	7026	9.169	7029	21,25	7032	19,51	7035	20,98	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

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: 31/12/2020

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	10,00	4,90	4,98	4.9.2.2
SERIE C - ES0357326026	4,90	62,56	58,69	4.9.2.2
SERIE C - ES0357326026	1,00	0,30	0,29	4.9.2.2
SERIE B - ES0357326018	10,00	4,90	4,98	4.9.2.2
SERIE B - ES0357326018	11,30	37,44	41,31	4.9.2.2
SERIE B - ES0357326018	1,25	0,30	0,29	4.9.2.2
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0357326026	7,00	6,79	6,79	3.4.6.2.2.
SERIE B - ES0357326018	9,40	6,79	6,79	3.4.6.2.2.
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		22,42	21,03	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: 31/12/2020

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: 31/12/2020

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: 31/12/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo				Total
		30/03/2020	29/06/2020	28/09/2020	28/12/2020	
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	2.201	2.131	1.876	2.713	
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-37	-16	-37	-15	
Pagos por derivados	0889	-27	-18	-19	-27	
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-6.952	-6.952	-6.952	-6.952	
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-1.921	-1.784	-1.662	-2.059	
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-11	-11	-11	-9	
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0	0	
Saldo disponible	0894	204	302	147	604	
Liquidación de comisión variable	0895	204	302	147	604	1.257

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: 31/12/2020

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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