

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA
Número de registro del Fondo: 9815
NIF Fondo: V86082716
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: SI
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2019

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)

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.01
Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2019		Periodo anterior 31/12/2018
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	12.021.791	1001	13.740.081
I. Activos financieros a largo plazo	0002	12.021.791	1002	13.740.081
1. Activos titulizados	0003	12.021.791	1003	13.740.081
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	0	1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016	0	1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	0
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022	0	1022	0
1.20 Otros	0023	12.021.791	1023	13.740.081
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	0	1025	0
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

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.01

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	2.290.980	1041	2.506.924
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	2.208.350	1043	2.141.761
1. Activos titulizados	0044	1.718.290	1044	1.658.380
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	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	1.718.290	1064	1.658.380
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	0	1065	0
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	0	1066	0
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	0	1067	0
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	0	1068	0
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	490.060	1074	483.381
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	490.060	1077	483.381
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	82.630	1085	365.163
1. Tesorería	0086	82.630	1086	365.163
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	14.312.771	1088	16.247.005

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2019		Periodo anterior 31/12/2018
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	11.813.285	1089	11.760.719
I. Provisiones a largo plazo	0090	361.992	1090	304.495
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	361.992	1092	304.495
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	11.451.293	1094	11.456.224
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	11.451.293	1095	11.456.224
1.1 Series no subordinadas	0096	11.451.293	1096	11.456.224
1.2 Series subordinadas	0097	0	1097	0
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	0	1101	0
2.1 Préstamo subordinado	0102	0	1102	0
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

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.01

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) PASIVO CORRIENTE	0117	2.499.485	1117	4.486.286
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	2.496.010	1123	4.482.743
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	2.496.010	1124	4.482.743
1.1 Series no subordinadas	0125	2.277.554	1125	4.206.425
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	218.456	1128	276.318
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	0	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	0
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	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	3.475	1148	3.543
1. Comisiones	0149	26	1149	29
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	4	1150	5
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	21	1152	24
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	3.449	1157	3.514
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	0	1158	0
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	0	1160	0
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	14.312.771	1162	16.247.005

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2019		Acumulado anterior 31/12/2018
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	94.339	1201	116.663	2201	393.168	3201	538.430
1.1 Activos titulizados	0202	94.339	1202	116.663	2202	393.168	3202	538.430
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-77.268	1204	-97.470	2204	-329.840	3204	-474.607
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-77.008	1205	-96.934	2205	-329.079	3205	-473.867
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-261	1206	-535	2206	-760	3206	-741
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	0	1208	0	2208	0	3208	0
A) MARGEN DE INTERESES	0209	17.071	1209	19.193	2209	63.328	3209	63.823
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	-442	1217	-1.767	2217	-5.831	3217	-6.886
7.1 Servicios exteriores	0218	-274	1218	-1.576	2218	-5.080	3218	-6.047
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-7	1219	-1.239	2219	-2.832	3219	-3.537
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	-267	1220	-336	2220	-2.247	3220	-2.510
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	-169	1224	-191	2224	-752	3224	-839
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-29	1225	-33	2225	-130	3225	-146
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-140	1227	-158	2227	-617	3227	-688
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	-4	3230	-4
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	-16.628	1234	-17.427	2234	-57.497	3234	-56.937
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	-16.628	1236	-17.427	2236	-57.497	3236	-56.937
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: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2019		Acumulado anterior 31/12/2018
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	68.447	1300	112.878	2300	14.952	3300	10.171
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	68.797	1301	113.325	2301	17.956	3301	13.509
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	97.503	1302	136.192	2302	415.492	3302	588.459
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-28.698	1303	-21.478	2303	-396.775	3303	-574.100
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	0	1305	0	2305	0	3305	0
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	-261	1307	-535	2307	-760	3307	-741
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	252	1308	-853	2308	-1	3308	-109
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-350	1309	-447	2309	-3.004	3309	-3.339
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-29	1310	-33	2310	-131	3310	-147
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-138	1312	-156	2312	-620	3312	-690
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	-184	1314	-258	2314	-2.253	3314	-2.502
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	10.967	1322	248.108	2322	-297.486	3322	158.006
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	997.550	2323	2.278.908	3323	2.677.477
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	343.713	1325	385.883	2325	-2.575.623	3325	-2.518.711
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	413.713	1326	385.883	2326	1.629.377	3326	1.531.289
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	0	1327	0	2327	0	3327	0
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	0	1328	0	2328	0	3328	0
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	-70.000	1331	0	2331	-4.205.000	3331	-4.050.000
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-332.746	1332	-1.135.326	2332	-770	3332	-761
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	91.592	1333	0	2333	2.089.780	3333	1.309.829
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	-424.210	1334	-1.135.267	2334	-2.089.780	3334	-1.309.829
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-129	1336	-58	2336	-770	3336	-761
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	79.414	1337	360.986	2337	-282.533	3337	168.177
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	3.215	1338	4.177	2338	365.163	3338	196.986
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	82.630	1339	365.163	2339	82.630	3339	365.163

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2019		Acumulado anterior 31/12/2018
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	0	1357	0	2357	0	3357	0
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	0	1358	0	2358	0	3358	0
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	0	1360	0	2360	0	3360	0
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	0	1362	0	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

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.1

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: ENDESA, IBERDROLA, E.ON ESPAÑA, E.ON GENERACIÓN, GAS NATURAL SDG, UNIÓN ELÉCTRICA DE CANARIAS GENERACIÓN, ELCOGÁS, GAS Y ELECTRICIDAD GENERACION, ENDESA GENERACIÓN, HIDROELÉCTRICA DEL CANTÁBRICO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2019								Situación cierre anual anterior 31/12/2018								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		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
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	0,00	0419	0,00	0439	0,00	0459	0,00	1399	0,00	1419	0,00	1439	0,00	1459	0,00	2399	0,00	2419	0,00	2439	0,00	2459	0,00

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.1

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: ENDESA, IBERDROLA, E.ON ESPAÑA, E.ON GENERACIÓN, GAS NATURAL SDG, UNIÓN ELÉCTRICA DE CANARIAS GENERACIÓN, ELCOGÁS, GAS Y ELECTRICIDAD GENERACION, ENDESA GENERACIÓN, HIDROELÉCTRICA DEL CANTÁBRICO

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	0	0467	0	0474	0	0481	0	0488	0	0495	0	0502	0	0509	0
De 1 a 3 meses	0461	0	0468	0	0475	0	0482	0	0489	0	0496	0	0503	0	0510	0
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	0	0470	0	0477	0	0484	0	0491	0	0498	0	0505	0	0512	0
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	0	0472	0	0479	0	0486	0	0493	0	0500	0	0507	0	0514	0
Total	0466	0	0473	0	0480	0	0487	0	0494	0	0501	0	0508	0	1515	0

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	0	0522	0	0529	0	0536	0	0543	0	0550	0	0557	0	0564	0	0571	0	0578	0	0584	0,00
De 1 a 3 meses	0516	0	0523	0	0530	0	0537	0	0544	0	0551	0	0558	0	0565	0	0572	0	0579	0	0585	0,00
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	0	0525	0	0532	0	0539	0	0546	0	0553	0	0560	0	0567	0	0574	0	0581	0	0587	0,00
De 9 a 12 meses	0519	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	0	0527	0	0534	0	0541	0	0548	0	0555	0	0562	0	0569	0	0576	0	0583	0	0589	0,00
Total	0521	0	0528	0	0535	0	0542	0	0549	0	0556	0	0563	0	0570	0	0577	0			0590	0,00

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.1

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: ENDESA, IBERDROLA, E.ON ESPAÑA, E.ON GENERACIÓN, GAS NATURAL SDG, UNIÓN ELÉCTRICA DE CANARIAS GENERACIÓN, ELCOGÁS, GAS Y ELECTRICIDAD GENERACION, ENDESA GENERACIÓN, HIDROELÉCTRICA DEL CANTÁBRICO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 23/11/2010	
Inferior a 1 año	0600	0	1600	0	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	0	1601	0	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	0	1602	0	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	0	1603	0	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	0	1604	0	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	13.740.081	1605	15.398.461	2605	0
Superior a 10 años	0606	0	1606	0	2606	24.189.838
Total	0607	13.740.081	1607	15.398.461	2607	24.189.838
Vida residual media ponderada (años)	0608	7,39	1608	8,37	2608	14,94

Antigüedad	Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 23/11/2010	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	7,45	1609	6,46	2609	0,00

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.1

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: ENDESA, IBERDROLA, E.ON ESPAÑA, E.ON GENERACIÓN, GAS NATURAL SDG, UNIÓN ELÉCTRICA DE CANARIAS GENERACIÓN, ELCOGÁS, GAS Y ELECTRICIDAD GENERACION, ENDESA GENERACIÓN, HIDROELÉCTRICA DEL CANTÁBRICO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 23/11/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	0	0630	0	1620	0	1630	0	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	0	0631	0	1621	0	1631	0	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	0	0632	0	1622	0	1632	0	2622	0	2632	0
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	0	0638	0	1628	0	1638	0	2628	0	2638	0
Media ponderada (%)	0639	0,00	0649		1639	0,00	1649		2639	0,00	2649	

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.1

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: ENDESA, IBERDROLA, E.ON ESPAÑA, E.ON GENERACIÓN, GAS NATURAL SDG, UNIÓN ELÉCTRICA DE CANARIAS GENERACIÓN, ELCOGÁS, GAS Y ELECTRICIDAD GENERACION, ENDESA GENERACIÓN, HIDROELÉCTRICA DEL CANTÁBRICO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 23/11/2010	
Tipo de interés medio ponderado	0650	2,79	1650	3,66	2650	4,83
Tipo de interés nominal máximo	0651	2,79	1651	3,66	2651	8,11
Tipo de interés nominal mínimo	0652	2,79	1652	3,66	2652	2,69

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.1

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: ENDESA, IBERDROLA, E.ON ESPAÑA, E.ON GENERACIÓN, GAS NATURAL SDG, UNIÓN ELÉCTRICA DE CANARIAS GENERACIÓN, ELCOGÁS, GAS Y ELECTRICIDAD GENERACION, ENDESA GENERACIÓN, HIDROELÉCTRICA DEL CANTÁBRICO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 23/11/2010			
	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	0	2683	0
Aragón	0661	0	0684	0	1661	0	1684	0	2661	0	2684	0
Asturias	0662	0	0685	0	1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663	0	0686	0	1663	0	1686	0	2663	0	2686	0
Canarias	0664	0	0687	0	1664	0	1687	0	2664	0	2687	0
Cantabria	0665	0	0688	0	1665	0	1688	0	2665	0	2688	0
Castilla-León	0666	0	0689	0	1666	0	1689	0	2666	0	2689	0
Castilla La Mancha	0667	0	0690	0	1667	0	1690	0	2667	0	2690	0
Cataluña	0668	0	0691	0	1668	0	1691	0	2668	0	2691	0
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	0	0694	0	1671	0	1694	0	2671	0	2694	0
Madrid	0672	43	0695	13.740.081	1672	43	1695	15.398.461	2672	43	2695	24.189.838
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	0	0697	0	1674	0	1697	0	2674	0	2697	0
Navarra	0675	0	0698	0	1675	0	1698	0	2675	0	2698	0
La Rioja	0676	0	0699	0	1676	0	1699	0	2676	0	2699	0
Comunidad Valenciana	0677	0	0700	0	1677	0	1700	0	2677	0	2700	0
País Vasco	0678	0	0701	0	1678	0	1701	0	2678	0	2701	0
Total España	0679	43	0702	13.740.081	1679	43	1702	15.398.461	2679	43	2702	24.189.838
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	43	0705	13.740.081	1682	43	1705	15.398.461	2682	43	2705	24.189.838

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.1
Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2019
Entidades cedentes de los activos titulizados: ENDESA, IBERDROLA, E.ON ESPAÑA, E.ON GENERACIÓN, GAS NATURAL SDG, UNIÓN ELÉCTRICA DE CANARIAS GENERACIÓN, ELCOGÁS, GAS Y ELECTRICIDAD GENERACION, ENDESA GENERACIÓN, HIDROELÉCTRICA DEL CANTÁBRICO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 23/11/2010			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	100,00			1710	100,00			2710	100,00		
Sector	0711	100,00	0712	35	1711	100,00	1712	35	2711	100,00	2712	35

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.2

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2019			Situación cierre anual anterior 31/12/2018			Situación inicial 23/11/2010		
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722
ES0378641007	Serie 1	0	0	0	0	0	0	25.050	100.000	2.505.000
ES0378641015	Serie 2	0	0	0	0	0	0	28.500	100.000	2.850.000
ES0378641023	Serie 3	26.490	100.000	2.649.000	26.490	100.000	2.649.000	26.490	100.000	2.649.000
ES0378641031	Serie 4	0	0	0	0	0	0	22.250	100.000	2.225.000
ES0378641049	Serie 5	0	0	0	0	0	0	20.660	100.000	2.066.000
ES0378641056	Serie 6	2.000	100.000	200.000	2.000	100.000	200.000	2.000	100.000	200.000
ES0378641064	Serie 7	1.250	100.000	125.000	1.250	100.000	125.000	1.250	100.000	125.000
ES0378641072	Serie 8	0	0	0	0	0	0	2.000	100.000	200.000
ES0378641080	Serie 9	6.088	100.000	608.800	6.088	100.000	608.800	6.088	100.000	608.800
ES0378641098	Serie 10	6.420	100.000	642.000	6.420	100.000	642.000	6.420	100.000	642.000
ES0378641106	Serie 11	1.250	100.000	125.000	1.250	100.000	125.000	1.250	100.000	125.000
ES0378641114	Serie 12	0	0	0	0	0	0	9.440	100.000	944.000
ES0378641122	Serie 13	0	0	0	0	0	0	17.500	100.000	1.750.000
ES0378641130	Serie 14	0	0	0	0	0	0	12.320	100.000	1.232.000
ES0378641148	Serie 15	890	100.000	89.000	890	100.000	89.000	890	100.000	89.000
ES0378641155	Serie 16	0	0	0	0	0	0	18.250	100.000	1.825.000
ES0378641163	Serie 17	0	0	0	0	0	0	23.250	100.000	2.325.000
ES0378641171	Serie 18	0	0	0	21.250	100.000	2.125.000	21.250	100.000	2.125.000
ES0378641189	Serie 19	0	0	0	0	0	0	15.000	100.000	1.500.000
ES0378641197	Serie 20	0	0	0	0	0	0	17.870	100.000	1.787.000
ES0378641205	Serie 21	0	0	0	20.100	100.000	2.010.000	20.100	100.000	2.010.000
ES0378641213	Serie 22	2.744	100.000	274.400	2.744	100.000	274.400	2.744	100.000	274.400
ES0378641221	Serie 23	1.200	100.000	120.000	1.200	100.000	120.000	1.200	100.000	120.000
ES0378641239	Serie 24	10.160	100.000	1.016.000	10.160	100.000	1.016.000	10.160	100.000	1.016.000
ES0378641247	Serie 26	2.000	100.000	200.000	2.000	100.000	200.000	2.000	100.000	200.000
ES0378641254	Serie 25	3.200	100.000	320.000	3.200	100.000	320.000	3.200	100.000	320.000

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

ES0378641262	Serie 27		0	0	0	700	100.000	70.000	700	100.000	70.000			
ES0378641270	Serie 28		4.580	100.000	458.000	1.880	100.000	188.000	4.580	100.000	458.000			
ES0378641288	Serie 29		11.340	100.000	1.134.000	11.340	100.000	1.134.000	11.340	100.000	1.134.000			
ES0378641296	Serie 30		1.407	100.000	140.700	1.407	100.000	140.700	1.407	100.000	140.700			
ES0378641304	Serie 31		11.200	100.000	1.120.000	11.200	100.000	1.120.000	11.200	100.000	1.120.000			
ES0378641312	Serie 32		15.000	100.000	1.500.000	15.000	100.000	1.500.000	15.000	100.000	1.500.000			
ES0378641320	Serie 33		10.000	100.000	1.000.000	10.000	100.000	1.000.000	10.000	100.000	1.000.000			
ES0378641338	Serie 34		10.000	100.000	1.000.000	0	0	0	10.000	100.000	1.000.000			
ES0378641346	Serie 35		10.000	100.000	1.000.000	0	0	0	10.000	100.000	1.000.000			
Total		0723	137.219		0724	13.721.900	1723	156.569	1724	15.656.900	2723	391.359	2724	39.135.900

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.2

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2019

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	0738	0739
						0734	0735		0742	0736		
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739
ES0378641007	Serie 1	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0
ES0378641015	Serie 2	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0
ES0378641023	Serie 3	NS	Tipo Fijo	0,00	5,90	123.410	0	NO	2.649.000	0	2.772.410	0
ES0378641031	Serie 4	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0
ES0378641049	Serie 5	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0
ES0378641056	Serie 6	NS	Tipo Fijo	0,00	5,00	383	0	NO	200.000	0	200.383	0
ES0378641064	Serie 7	NS	Tipo Fijo	0,00	5,00	3.364	0	NO	125.000	0	128.364	0
ES0378641072	Serie 8	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0
ES0378641080	Serie 9	NS	Tipo Fijo	0,00	6,25	30.045	0	NO	608.800	0	638.845	0
ES0378641098	Serie 10	NS	Tipo Fijo	0,00	6,46	32.748	0	NO	642.000	0	674.748	0
ES0378641106	Serie 11	NS	Tipo Fijo	0,00	6,50	6.416	0	NO	125.000	0	131.416	0
ES0378641114	Serie 12	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0
ES0378641122	Serie 13	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0
ES0378641130	Serie 14	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0
ES0378641148	Serie 15	NS	Tipo Fijo	0,00	5,75	196	0	NO	89.000	0	89.196	0
ES0378641155	Serie 16	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0
ES0378641163	Serie 17	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0
ES0378641171	Serie 18	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0
ES0378641189	Serie 19	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0
ES0378641197	Serie 20	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0
ES0378641205	Serie 21	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0
ES0378641213	Serie 22	NS	Tipo Fijo	0,00	1,45	2.142	0	NO	274.400	0	276.542	0
ES0378641221	Serie 23	NS	Tipo Fijo	0,00	1,80	1.163	0	NO	120.000	0	121.163	0
ES0378641239	Serie 24	NS	Tipo Fijo	0,00	0,50	194	0	NO	1.016.000	0	1.016.194	0
ES0378641247	Serie 26	NS	Tipo Fijo	0,00	1,00	574	0	NO	200.000	0	200.574	0

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

ES0378641254	Serie 25	NS	Tipo Fijo	0,00	0,13	115	0	NO	320.000	0	320.115	0						
ES0378641262	Serie 27	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0						
ES0378641270	Serie 28	NS	Tipo Fijo	0,00	0,75	2.712	0	NO	458.000	0	460.712	0						
ES0378641288	Serie 29	NS	Tipo Fijo	0,00	0,63	5.596	0	NO	1.134.000	0	1.139.596	0						
ES0378641296	Serie 30	NS	Tipo Fijo	0,00	0,13	139	0	NO	140.700	0	140.839	0						
ES0378641304	Serie 31	NS	Tipo Fijo	0,00	0,03	187	0	NO	1.120.000	0	1.120.187	0						
ES0378641312	Serie 32	NS	Tipo Fijo	0,00	0,50	5.922	0	NO	1.500.000	0	1.505.922	0						
ES0378641320	Serie 33	NS	Tipo Fijo	0,00	0,85	325	0	NO	1.000.000	0	1.000.325	0						
ES0378641338	Serie 34	NS	Tipo Fijo	0,00	0,50	2.691	0	NO	1.000.000	0	1.002.691	0						
ES0378641346	Serie 35	NS	Tipo Fijo	0,00	0,05	135	0	NO	1.000.000	0	1.000.135	0						
Total						0740	218.456	0741	0		0743	13.721.900	0744	0	0745	13.940.356	0746	0

	Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 23/11/2010	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	2,24	0748	2,80	0749	3,21

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.2

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2019				Situación periodo comparativo anterior 31/12/2018			
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
ES0378641007	Serie 1	0	2.505.000	0	374.134	0	2.505.000	0	374.134
ES0378641015	Serie 2	0	2.850.000	0	600.959	0	2.850.000	0	600.959
ES0378641023	Serie 3	0	0	0	1.187.983	0	0	0	1.031.692
ES0378641031	Serie 4	0	2.225.000	0	817.811	0	2.225.000	0	817.811
ES0378641049	Serie 5	0	2.066.000	0	177.337	0	2.066.000	0	177.337
ES0378641056	Serie 6	0	0	10.000	76.660	0	0	10.000	66.660
ES0378641064	Serie 7	0	0	0	46.909	0	0	0	40.659
ES0378641072	Serie 8	0	200.000	0	19.378	0	200.000	0	19.378
ES0378641080	Serie 9	0	0	0	239.183	0	0	0	201.133
ES0378641098	Serie 10	0	0	0	276.953	0	0	0	235.480
ES0378641106	Serie 11	0	0	0	57.297	0	0	0	49.172
ES0378641114	Serie 12	0	944.000	0	262.252	0	944.000	0	262.252
ES0378641122	Serie 13	0	1.750.000	0	211.151	0	1.750.000	0	211.151
ES0378641130	Serie 14	0	1.232.000	0	190.356	0	1.232.000	0	190.356
ES0378641148	Serie 15	0	0	5.118	34.995	0	0	5.118	29.878
ES0378641155	Serie 16	0	1.825.000	0	352.819	0	1.825.000	0	352.819
ES0378641163	Serie 17	0	2.325.000	0	219.955	0	2.325.000	0	219.955
ES0378641171	Serie 18	0	2.125.000	0	390.818	0	0	0	319.099
ES0378641189	Serie 19	0	1.500.000	0	104.856	0	1.500.000	0	104.856
ES0378641197	Serie 20	0	1.787.000	0	111.165	0	1.787.000	0	111.165
ES0378641205	Serie 21	0	2.010.000	0	71.367	0	0	0	54.282
ES0378641213	Serie 22	0	0	0	11.589	0	0	0	7.610
ES0378641221	Serie 23	0	0	0	6.616	0	0	0	4.456
ES0378641239	Serie 24	0	0	5.080	17.579	0	0	5.080	12.499
ES0378641247	Serie 26	0	0	0	5.858	0	0	0	3.858

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

ES0378641254	Serie 25	0	0	0	0	1.172	0	0	0	772							
ES0378641262	Serie 27	70.000	70.000	0	0	0	0	0	0	0							
ES0378641270	Serie 28	0	0	0	0	5.421	0	0	0	1.986							
ES0378641288	Serie 29	0	0	0	0	14.774	0	0	0	7.687							
ES0378641296	Serie 30	0	0	0	0	362	0	0	0	186							
ES0378641304	Serie 31	0	0	0	0	695	0	0	0	348							
ES0378641312	Serie 32	0	0	0	0	8.240	0	0	0	740							
ES0378641320	Serie 33	0	0	8.500	0	9.781	0	0	1.281	1.281							
ES0378641338	Serie 34	0	0	0	0	2.000	0	0	0	0							
ES0378641346	Serie 35	0	0	0	0	0	0	0	0	0							
Total		0754	70.000	0755	25.414.000	0756	28.698	0757	5.908.422	1754	0	1755	21.209.000	1756	21.478	1757	5.511.647

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.2

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2019

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 31/12/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 23/11/2010
				0762	0763	0764
ES0378641007	Serie 1	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641007	Serie 1	08/06/2012	FCH	BBB	BBB	AA+
ES0378641007	Serie 1	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Aa1
ES0378641007	Serie 1	16/10/2012	SYP	BBB-	BBB-	AA
ES0378641015	Serie 2	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641015	Serie 2	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	AA+
ES0378641015	Serie 2	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Aa1
ES0378641015	Serie 2	23/05/2014	SYP	BBB	BBB	AA
ES0378641023	Serie 3	30/04/2018	DBRS	A	A	A (low)
ES0378641023	Serie 3	24/01/2018	FCH	A-	A-	AA+
ES0378641023	Serie 3	23/04/2018	MDY	Baa1	Baa1	Aa2
ES0378641023	Serie 3	20/09/2019	SYP	A	A-	AA
ES0378641031	Serie 4	30/04/2018	DBRS	A	A	A (low)
ES0378641031	Serie 4	24/01/2018	FCH	A-	A-	AA+
ES0378641031	Serie 4	23/04/2018	MDY	Baa1	Baa1	Aa2
ES0378641031	Serie 4	23/03/2018	SYP	A-	A-	AA
ES0378641049	Serie 5	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641049	Serie 5	08/06/2012	FCH	BBB	BBB	AA+
ES0378641049	Serie 5	22/06/2012	MDY	Baa3	Baa3	Aa2
ES0378641049	Serie 5	16/10/2012	SYP	BBB-	BBB-	AA
ES0378641056	Serie 6	30/04/2018	DBRS	A	A	A (low)
ES0378641056	Serie 6	20/09/2019	SYP	A	A-	AA-
ES0378641064	Serie 7	30/04/2018	DBRS	A	A	A (low)
ES0378641064	Serie 7	20/09/2019	SYP	A	A-	AA-
ES0378641072	Serie 8	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641072	Serie 8	16/10/2012	SYP	BBB-	BBB-	A

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

ES0378641080	Serie 9	30/04/2018	DBRS	A	A	A (low)
ES0378641080	Serie 9	20/09/2019	SYP	A	A-	A
ES0378641098	Serie 10	30/04/2018	DBRS	A	A	A (low)
ES0378641098	Serie 10	24/01/2018	FCH	A-	A-	A
ES0378641098	Serie 10	23/04/2018	MDY	Baa1	Baa1	A3
ES0378641098	Serie 10	20/09/2019	SYP	A	A-	A
ES0378641106	Serie 11	30/04/2018	DBRS	A	A	A (low)
ES0378641106	Serie 11	20/09/2019	SYP	A	A-	A
ES0378641114	Serie 12	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641114	Serie 12	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	A
ES0378641122	Serie 13	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641122	Serie 13	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	BBB
ES0378641122	Serie 13	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Baa3
ES0378641122	Serie 13	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	BBB-
ES0378641130	Serie 14	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641130	Serie 14	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	BBB
ES0378641130	Serie 14	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Baa3
ES0378641130	Serie 14	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	BBB-
ES0378641148	Serie 15	30/04/2018	DBRS	A	A	A (low)
ES0378641148	Serie 15	20/09/2019	SYP	A	A-	BBB-
ES0378641155	Serie 16	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641155	Serie 16	24/01/2018	FCH	A-	A-	BBB
ES0378641155	Serie 16	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Baa3
ES0378641155	Serie 16	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	BBB-
ES0378641163	Serie 17	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641163	Serie 17	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	BBB
ES0378641163	Serie 17	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Baa3
ES0378641163	Serie 17	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	BBB-
ES0378641171	Serie 18	30/04/2018	DBRS	A	A	A (low)
ES0378641171	Serie 18	24/01/2018	FCH	A-	A-	BBB
ES0378641171	Serie 18	23/04/2018	MDY	Baa1	Baa1	Baa3
ES0378641171	Serie 18	23/03/2018	SYP	A-	A-	BBB-
ES0378641189	Serie 19	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641189	Serie 19	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	BBB
ES0378641189	Serie 19	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Baa3
ES0378641189	Serie 19	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	BBB-
ES0378641197	Serie 20	21/02/2014	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641197	Serie 20	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	BBB
ES0378641197	Serie 20	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Baa3
ES0378641197	Serie 20	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	BBB-
ES0378641205	Serie 21	30/04/2018	DBRS	A	A	A (low)
ES0378641205	Serie 21	24/01/2018	FCH	A-	A-	BBB+

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

ES0378641205	Serie 21	23/04/2018	MDY	Baa1	Baa1	Baa2
ES0378641205	Serie 21	23/03/2018	SYP	A-	A-	BBB
ES0378641213	Serie 22	20/09/2019	SYP	A	A-	BBB+
ES0378641221	Serie 23	20/09/2019	SYP	A	A-	BBB+
ES0378641239	Serie 24	20/09/2019	SYP	A	A-	BBB+
ES0378641247	Serie 26	20/09/2019	SYP	A	A-	BBB+
ES0378641254	Serie 25	20/09/2019	SYP	A	A-	BBB+
ES0378641262	Serie 27	23/04/2018	MDY	Baa1	Baa1	Baa2
ES0378641262	Serie 27	20/09/2019	SYP	A	A-	BBB+
ES0378641270	Serie 28	23/04/2018	MDY	Baa1	Baa1	Baa2
ES0378641270	Serie 28	20/09/2019	SYP	A	A-	BBB+
ES0378641288	Serie 29	30/04/2018	DBRS	A	A	A (low)
ES0378641288	Serie 29	24/01/2018	FCH	A-	A-	BBB+
ES0378641288	Serie 29	23/04/2018	MDY	Baa1	Baa1	Baa2
ES0378641288	Serie 29	20/09/2019	SYP	A	A-	BBB+
ES0378641296	Serie 30	24/01/2018	FCH	A-	A-	BBB+
ES0378641296	Serie 30	20/09/2019	SYP	A	A-	BBB+
ES0378641304	Serie 31	30/04/2018	DBRS	A	A	A (low)
ES0378641304	Serie 31	24/01/2018	FCH	A-	A-	BBB+
ES0378641304	Serie 31	23/04/2018	MDY	Baa1	Baa1	Baa2
ES0378641304	Serie 31	20/09/2019	SYP	A	A-	BBB+
ES0378641312	Serie 32	30/04/2018	DBRS	A	A	A (low)
ES0378641312	Serie 32	09/02/2018	FCH	A-	A-	A-
ES0378641312	Serie 32	20/09/2019	SYP	A	A-	BBB+
ES0378641320	Serie 33	23/10/2018	DBRS	A	A	A
ES0378641320	Serie 33	23/10/2018	FCH	A-	A-	A-
ES0378641320	Serie 33	20/09/2019	SYP	A	A-	A-
ES0378641338	Serie 34	22/01/2019	DBRS	A		A
ES0378641338	Serie 34	22/01/2019	FCH	A-		A-
ES0378641338	Serie 34	20/09/2019	SYP	A		A-
ES0378641346	Serie 35	23/09/2019	DBRS	A		A
ES0378641346	Serie 35	23/09/2019	FCH	A-		A-
ES0378641346	Serie 35	24/09/2019	SYP	A		A-

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.2
Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/12/2019
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 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 23/11/2010	
Inferior a 1 año	0765	2.276.700	1765	4.205.000	2765	
Entre 1 y 2 años	0766	2.969.000	1766	2.276.700	2766	2.585.000
Entre 2 y 3 años	0767	1.307.700	1767	2.969.000	2767	1.360.700
Entre 3 y 4 años	0768	1.500.000	1768	1.307.700	2768	11.470.000
Entre 4 y 5 años	0769	2.288.700	1769	1.600.700	2769	9.959.400
Entre 5 y 10 años	0770	3.379.800	1770	3.297.800	2770	11.967.500
Superior a 10 años	0771		1771		2771	1.793.300
Total	0772	13.721.900	1772	15.656.900	2772	39.135.900
Vida residual media ponderada (años)	0773	3,18	1773	2,89	2773	4,97

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.3

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 23/11/2010	
1	Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775		1775		2775	
1.1	Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776		1776		2776	
1.2	Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777		1777		2777	
1.3	Denominación de la contrapartida	0778		1778		2778	
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	2.000.000	1781	2.000.000	2781	2.000.000
2.1	Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	14,58	1782	12,77	2782	5,11
2.2	Denominación de la contrapartida	0783	ICO	1783	ICO	2783	ICO
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	13.721.900	1786	15.656.900	2786	26.000.000
3.1	Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	100,00	1787	100,00	2787	66,44
3.2	Denominación de la entidad avalista	0788	Administración General del Estado	1788	Administración General del Estado	2788	Administración General del Estado
3.3	Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4	Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4	Subordinación de series (S/N)	0791	N	1791	N	2791	N
4.1	Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100,00	1792	100,00	2792	100,00
5	Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1	Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2	Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3	Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.3

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

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 31/12/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 23/11/2010			
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806		
Total						0808		0809		0810	

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.3

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

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 31/12/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 23/11/2010	Situación actual 31/12/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 23/11/2010		
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	

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.4

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

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 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Última Fecha Pago
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002		7003		7006		7009		7012		7015		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016		
Total Morosos					7005		7008		7011		7014		7017		7018
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019		7020		7021		7024		7027		7030		7033		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022		7025		7028		7031		7034		
Total Fallidos					7023		7026		7029		7032		7035		7036

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto		
	Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Última Fecha Pago
	0850		1850		2850		3850
	0851		1851		2851		3851
	0852		1852		2852		3852
	0853		1853		2853		3853

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.4

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

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
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.5

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

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 Pago de los Bonos en fecha de Pago inmediatamente anterior a la Fecha de Pago.	3862	0,001	4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	Instituto de Crédito Oficial	1864	15	2864	Saldo Nominal Pendiente de Pago de los Bonos en la Fecha de Pago inmediatamente anterior.	3864	0,003	4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.5
Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2019

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	N
3 Otros (S/N)	0868	S
3.1 Descripción	0869	En la Fecha de Liquidación del Fondo, el remanente en las Cuentas del Fondo se transferirá a la CNMC.
Contrapartida	0870	CNMC
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Documento de Registro de Valores de Titulización 4.4.3.

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														

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.5

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885												
Saldo inicial	0886												
Cobros del periodo	0887												
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888												
Pagos por derivados	0889												
Retención importe Fondo de Reserva	0890												
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891												
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892												
Resto pagos/retenciones	0893												
Saldo disponible	0894												
Liquidación de comisión variable	0895												

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.06

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

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