

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: TWC NOTES, FONDO DE TITULIZACION
Número de registro del Fondo: 202200015
NIF Fondo: V72433279
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: SI
Fondo Privado: SI
Estados agregados: SI
Fecha: 31/03/2024

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2024		Periodo anterior 31/12/2023
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001		1001	
I. Activos financieros a largo plazo	0002		1002	
1. Activos titulizados	0003		1003	
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025		1025	
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027		1027	
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	98.238	1041	99.106
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	72.216	1043	71.852
1. Activos titulizados	0044	72.216	1044	71.852
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046		1046	
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064	72.216	1064	71.852
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065		1065	
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066		1066	
1.23 Activos dudosos -principal-	0067		1067	
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068		1068	
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069		1069	
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	26.022	1085	27.254
1. Tesorería	0086	26.022	1086	27.254
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	98.238	1088	99.106

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2024		Periodo anterior 31/12/2023
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	75.606	1089	75.000
I. Provisiones a largo plazo	0090		1090	
1. Provisión garantías financieras	0091		1091	
2. Provisión por margen de intermediación	0092		1092	
3. Otras provisiones	0093		1093	
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	75.606	1094	75.000
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	75.606	1095	75.000
1.1 Series no subordinadas	0096	75.000	1096	75.000
1.2 Series subordinadas	0097		1097	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	606	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101		1101	
2.1 Préstamo subordinado	0102		1102	
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105		1105	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108		1108	
3.1 Derivados de cobertura	0109		1109	
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) PASIVO CORRIENTE	0117	22.631	1117	24.106
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	
V. Provisiones a corto plazo	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120		1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121		1121	
3. Otras provisiones	0122		1122	
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	21.864	1123	22.251
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	20.059	1124	21.385
1.1 Series no subordinadas	0125	20.000	1125	20.000
1.2 Series subordinadas	0126		1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	59	1128	1.385
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131		1131	
2.1 Préstamo subordinado	0132		1132	
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136		1136	
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139		1139	
3.1 Derivados de cobertura	0140		1140	
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	1.805	1143	866
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	386	1144	1
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146	1.419	1146	865
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	768	1148	1.855
1. Comisiones	0149	758	1149	1.844
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	13	1150	13
1.2 Comisión administrador	0151	2	1151	2
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152		1152	
1.4 Comisión variable	0153	743	1153	1.828
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155		1155	
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	10	1157	11
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158		1158	
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160		1160	
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	98.238	1162	99.106

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2024		Acumulado anterior 31/03/2023
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	1.592	1201	1.241	2201	1.592	3201	1.241
1.1 Activos titulizados	0202	1.321	1202	1.139	2202	1.321	3202	1.139
1.2 Otros activos financieros	0203	271	1203	101	2203	271	3203	101
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-1.468	1204	-527	2204	-1.468	3204	-527
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.468	1205	-527	2205	-1.468	3205	-527
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206		1206		2206		3206	
2.3 Otros pasivos financieros	0207		1207	0	2207		3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208		1208		2208		3208	
A) MARGEN DE INTERESES	0209	123	1209	713	2209	123	3209	713
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210		1210		2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211		1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212		1212		2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213		1213		2213		3213	
4.4 Otros	0214		1214		2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215		1215		2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216		1216		2216		3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-123	1217	-713	2217	-123	3217	-713
7.1 Servicios exteriores	0218		1218	0	2218		3218	0
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219		1219	0	2219		3219	0
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220		1220		2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221		1221		2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222		1222	0	2222		3222	0
7.2 Tributos	0223	-1	1223	0	2223	-1	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-123	1224	-713	2224	-123	3224	-713
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-37	1225	-25	2225	-37	3225	-25
7.3.2 Comisión administrador	0226	-7	1226	-7	2226	-7	3226	-7
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227		1227	0	2227		3227	0
7.3.4 Comisión variable	0228	-79	1228	-681	2228	-79	3228	-681
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229		1229		2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230		1230		2230		3230	
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231		1231		2231		3231	
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232		1232		2232		3232	
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233		1233		2233		3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234		1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235		1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236		1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237		1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238		1238		2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239		1239	0	2239		3239	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241		1241		2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2024		Acumulado anterior 31/03/2023
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-3.132	1300	-342	2300	-3.132	3300	-342
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-1.917	1301	-153	2301	-1.917	3301	-153
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	0	1302	0	2302	0	3302	0
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-2.188	1303	-254	2303	-2.188	3303	-254
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	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	271	1308	101	2308	271	3308	101
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-1.208	1309	-189	2309	-1.208	3309	-189
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-37	1310	-25	2310	-37	3310	-25
2.2 Comisión administrador	0311	-7	1311	-7	2311	-7	3311	-7
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	-1.164	1313	-156	2313	-1.164	3313	-156
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-7	1315	-1	2315	-7	3315	-1
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	-7	1320	-1	2320	-7	3320	-1
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	1.900	1322	-5.983	2322	1.900	3322	-5.983
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	-39.831	1324	-11.075	2324	-39.831	3324	-11.075
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	41.732	1325	5.092	2325	41.732	3325	5.092
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	41.732	1326	5.292	2326	41.732	3326	5.292
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	0	1331	-200	2331	0	3331	-200
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332	0	2332	0	3332	0
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	0	1336	0	2336	0	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-1.231	1337	-6.326	2337	-1.231	3337	-6.326
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	27.254	1338	22.110	2338	27.254	3338	22.110
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	26.022	1339	15.785	2339	26.022	3339	15.785

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2024		Acumulado anterior 31/03/2023
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350		1350		2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351		1351		2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352		1352		2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353		1353		2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354		1354		2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0355		1355		2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356		1356		2356		3356	
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		1359		2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	0	1360	0	2360	0	3360	0
2.3 Otras reclasificaciones	0361		1361		2361		3361	
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 periodo	0364		1364		2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365		1365		2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366		1366		2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367		1367		2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368		1368		2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369		1369		2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/03/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				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
Préstamos corporativos	0387	0407	0427	0447	1387	1407	1427	1447	2387	2407	2427	2447
Cédulas territoriales	0388	0408	0428	0448	1388	1408	1428	1448	2388	2408	2428	2448
Bonos de tesorería	0389	0409	0429	0449	1389	1409	1429	1449	2389	2409	2429	2449
Deuda subordinada	0390	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

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados:

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	
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	
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	
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	
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	
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	
Total	0521	0	0528	0	0535	0	0542	0	0549	0	0556	0	0563	0	0570	0	0577	0			0590	

S.05.1

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 03/11/2022	
Inferior a 1 año	0600	72.216	1600	71.852	2600	392
Entre 1 y 2 años	0601	0	1601	0	2601	
Entre 2 y 3 años	0602	0	1602	0	2602	
Entre 3 y 4 años	0603	0	1603	0	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	0	1604	0	2604	
Entre 5 y 10 años	0605	0	1605	0	2605	
Superior a 10 años	0606	0	1606	0	2606	
Total	0607	72.216	1607	71.852	2607	392
Vida residual media ponderada (años)	0608	0,17	1608	0,39	2608	0,35

Antigüedad	Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 03/11/2022	
Antigüedad media ponderada (años)	0609		1609		2609	

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/03/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 03/11/2022			
	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		0649		1639		1649		2639		2649	

S.05.1

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 03/11/2022	
Tipo de interés medio ponderado	0650	13,74	1650	9,52	2650	
Tipo de interés nominal máximo	0651	29,25	1651	16,94	2651	
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,91	1652	3,71	2652	

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/03/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 03/11/2022			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	38	0683	372	1660	46	1683	675	2660	0	2683	0
Aragón	0661	9	0684	355	1661	3	1684	116	2661		2684	
Asturias	0662	5	0685	845	1662	0	1685	0	2662		2685	
Baleares	0663	0	0686	0	1663	0	1686	0	2663		2686	
Canarias	0664	2	0687	14	1664	0	1687	0	2664		2687	
Cantabria	0665	0	0688	0	1665	0	1688	0	2665		2688	
Castilla-León	0666	56	0689	10.628	1666	35	1689	10.443	2666		2689	
Castilla La Mancha	0667	10	0690	2.492	1667	14	1690	943	2667		2690	
Cataluña	0668	47	0691	1.808	1668	42	1691	1.402	2668	2	2691	392
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669		2692	
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	8	1693	160	2670		2693	
Galicia	0671	17	0694	507	1671	23	1694	2.141	2671		2694	
Madrid	0672	187	0695	16.997	1672	107	1695	16.377	2672		2695	
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673		2696	
Murcia	0674	0	0697	0	1674	14	1697	1.535	2674		2697	
Navarra	0675	208	0698	9.815	1675	210	1698	11.507	2675		2698	
La Rioja	0676	2	0699	90	1676	1	1699	93	2676		2699	
Comunidad Valenciana	0677	216	0700	6.126	1677	87	1700	4.388	2677		2700	
País Vasco	0678	79	0701	19.769	1678	83	1701	20.397	2678		2701	
Total España	0679	876	0702	69.818	1679	673	1702	70.176	2679	2	2702	392
Otros países Unión Europea	0680	56	0703	1.750	1680	45	1703	1.676	2680		2703	
Resto	0681	185	0704	648	1681	0	1704	0	2681		2704	
Total general	0682	1.117	0705	72.216	1682	718	1705	71.852	2682	2	2705	392

S.05.1
Denominación Fondo: TWC NOTES, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 31/03/2024
Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/03/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 03/11/2022			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0			1710	0			2710			
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: Otros

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2024			Situación cierre anual anterior 31/12/2023			Situación inicial 03/11/2022					
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			
222120200002	Bono2	1	25.000.000	25.000	1	25.000.000	25.000	1	0	0			
222121400001	Bono1	1	0	0	1	0	0	1	205.391	205			
222121400002	Bono2	1	20.000.000	20.000	1	20.000.000	20.000	1	0	0			
223011600001	Bono1	1	0	0	1	0	0	1	200.000	200			
223051600001	Bono1	1	0	0	1	0	0						
226050400002	Bono2	1	50.000.000	50.000	1	50.000.000	50.000						
Total		0723	6	0724	95.000	1723	6	1724	95.000	2723	4	2724	405

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: Otros

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
222120200002	Bono2	NS	EURIBOR 6 MESES	2	5,96	451	0	SI	25.000	0	25.451						
222121400001	Bono1	NS	EURIBOR MES	0	0	0	0	SI	0	0	0						
222121400002	Bono2	NS	EURIBOR 6 MESES	2	5,90	59	0	SI	20.000	0	20.059						
223011600001	Bono1	NS	EURIBOR MES	0	0	0	0	SI	0	0	0						
223051600001	Bono1	NS	EURIBOR MES	0	0	0	0	SI	0	0	0						
226050400002	Bono2	NS	EURIBOR 6 MESES	2,30	6,20	155	0	SI	50.000	0	50.155						
Total						0740	665	0741	0	0743	95.000	0744	0	0745	95.665	0746	

	Situación actual 31/03/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 03/11/2022
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0748	0749

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: Otros

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2024								Situación periodo comparativo anterior 31/03/2023							
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								
222121400001	Bono1	0	205	0	1	0	205	0	205	0	205	0	1	0	1		
222121400002	Bono2	0	0	603	1.413	200	200	1	1	0	0	1	1	0	0		
222120200002	Bono2	0	0	0	1.326												
223011600001	Bono1	0	200	0	1	0	0	0	0	253	253						
223051600001	Bono1	0	175	0	0												
226050400002	Bono2	0	0	1.584	2.675												
Total		0754	0	0755	580	0756	2.188	0757	5.415	1754	200	1755	405	1756	254	1757	255

S.05.2
Denominación Fondo: TWC NOTES, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Periodo de la declaración: 31/03/2024
Mercados de cotización de los valores emitidos: Otros

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 31/03/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 03/11/2022
		0760	0761	0762	0763	0764

S.05.2
Denominación Fondo: TWC NOTES, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Periodo de la declaración: 31/03/2024
Mercados de cotización de los valores emitidos: Otros

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 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 03/11/2022	
Inferior a 1 año	0765	20.000	1765	20.000	2765	405
Entre 1 y 2 años	0766	25.000	1766	25.000	2766	0
Entre 2 y 3 años	0767	50.000	1767	50.000	2767	
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	
Entre 5 y 10 años	0770		1770		2770	
Superior a 10 años	0771		1771		2771	
Total	0772	95.000	1772	95.000	2772	405
Vida residual media ponderada (años)	0773	1,68	1773	1,95	2773	0,10

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 03/11/2022	
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	Notas explicativas	1778	Notas explicativas	2778	Notas explicativas
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas explicativas	1779	Notas explicativas	2779	Notas explicativas
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas explicativas	1780	Notas explicativas	2780	Notas explicativas
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	Notas explicativas	1783	Notas explicativas	2783	Notas explicativas
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas explicativas	1784	Notas explicativas	2784	Notas explicativas
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785	Notas explicativas	1785	Notas explicativas	2785	Notas explicativas
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	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	Notas explicativas	1788	Notas explicativas	2788	Notas explicativas
3.3 Rating del avalista	0789	Notas explicativas	1789	Notas explicativas	2789	Notas explicativas
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas explicativas	1790	Notas explicativas	2790	Notas explicativas
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	1792	100	2792	100
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	

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

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 31/03/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 03/11/2022			
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806		
Total						0808		0809		0810	

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

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 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 03/11/2022		Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 03/11/2022			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

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 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	0	7003	0	7006	0	7009		7012		7015			
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	0	7008	0	7011		7014		7017	0	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	0	7020	0	7021	0	7024	0	7027		7030		7033			
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028		7031		7034			
Total Fallidos					7023	0	7026	0	7029	0	7032	0	7035	0	7036	

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto				
	Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023			Última Fecha Pago		
	0850		1850		2850		3850	
	0851		1851		2851		3851	
	0852		1852		2852		3852	
	0853		1853		2853		3853	

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

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

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

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		1862		2862		3862		4862		5862		6862		7862		8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864		1864		2864		3864		4864		5864		6864		7864		8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

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															

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

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												

S.06

Denominación Fondo: TWC NOTES, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2024

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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