

CAIXA PENEDES TDA 1 - Fondo de Titulización de Activos
LIQUIDACION DEL PERIODO 28/07/17 - 30/10/17

| | Euros |
|---|----------------------|
| I. Situación al 28/07/17: | 7.450.999,09 |
| Fondo de Reserva | 5.736.363,50 |
| Fondo para la amortización de la Línea de Liquidez | 1.714.635,59 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 12.926.760,90 |
| Principal: | |
| Según calendario hasta 30/09/17: | 5.485.875,53 |
| Amort. Anticipada hasta 30/09/17: | 6.076.410,35 |
| Intereses: | 1.364.475,02 |
| Avance técnico neto (1): | 0,00 |
| III. Subtotal Recursos disponibles (I + II): | 20.377.759,99 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | -18.028,67 |
| Intereses de la Cta. De Cobros | -4.737,54 |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | -11.570,26 |
| Intereses Línea de Liquidez | -1.720,87 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 20.359.731,32 |
| VI. Gastos: | 17.200,90 |
| VII. Recursos pendientes de aplicación | 270.558,77 |
| VIII. Línea Liquidez | 0,00 |
| Intereses | 0,00 |
| Amortización | 0,00 |
| IX. Liquidación SWAP: | -332.603,11 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (J.P. Morgan): | -322.033,08 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo): | 10.570,03 |
| X. Pago a los Bonos: | 11.641.449,30 |
| Bonos A: | |
| Intereses correspondientes al 30/10/17: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 30/10/17: | 10.386.635,00 |
| Bonos B: | |
| Intereses correspondientes al 30/10/17: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 30/10/17: | 723.489,10 |
| Bonos C: | |
| Intereses correspondientes al 30/10/17: | 7.419,30 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 1.409,67 |
| Amortización correspondiente al 30/10/17: | 523.905,90 |
| Reinversión o devolución de las retenciones: | -1.409,67 |
| XI. Saldo disponible (V- VI - VII -VIII + IX - X): | 8.097.919,24 |
| Distribución del saldo disponible: | |
| Fondo de Reserva previo (28/07/17): | 5.736.363,50 |
| Aportación al Fondo de Reserva | -232.680,60 |
| Fondo para la amortización de la Línea de Liquidez a 30/10/17 | 1.742.606,32 |
| Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada | 10.035,45 |
| Amortización Préstamo Participativo | 232.680,60 |
| Remuneración Variable Prést. Participativo | 608.913,97 |
| Fondo de Reserva 30/10/17: | 5.503.682,90 |

Destinatarios: CNMV, AIAF.


Nº: 4880/17

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

CAIXA PENEDES 1 TDA/liqu.trim/Oct17

CAIXA PENEDES TDA 1

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 30 de Octubre de 2017

Importes en euros

| I. BONOS A ES0313252001 | Sobre 9500 bonos | Por Bono |
|---|------------------|--------------|
| 1. Saldo inicial (23/10/2006): | 950.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 256.065.755,00 € | 26.954,29 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 10.386.635,00 € | 1.093,33 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 245.679.120,00 € | 25.860,96 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 25,86096% | 25,86096% |

| II. BONOS B ES0313252019 | Sobre 290 bonos | Por Bono |
|---|-----------------|--------------|
| 1. Saldo inicial (23/10/2006): | 29.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 17.836.403,60 € | 61.504,84 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 723.489,10 € | 2.494,79 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 17.112.914,50 € | 59.010,05 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 59,01005% | 59,01005% |

| III. BONOS C ES0313252027 | Sobre 210 bonos | Por Bono |
|---|-----------------|--------------|
| 1. Saldo inicial (23/10/2006): | 21.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 12.916.016,40 € | 61.504,84 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 7.419,30 € | 35,33 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 523.905,90 € | 2.494,79 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 12.392.110,50 € | 59.010,05 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 59,01005% | 59,01005% |

| IV. EL FONDO | Importes en euros |
|--|-------------------|
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 30/09/17: | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas: | 275.184.096,78 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas: | 6.922.812,46 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas: | 275.277.626,94 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidas: | 7.219.979,88 € |
| 2. Amortización del período 30/06/17 a 30/09/17: | 11.562.285,88 € |
| a) Según calendario: | 5.485.875,53 € |
| b) Amortización anticipada hasta 30/09/17: | 6.076.410,35 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | |
| a) Ultimo año: | 6,53% |
| b) Ultimo semestre: | 7,35% |
| c) Ultimo trimestre: | 8,21% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | 0,44% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses: | 0,14% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | 2,56% |
| 7. Nivel de Impago (2): | 0,26% |

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

(2) Importe de principal de las Participaciones Hipotecarias impagadas durante el período de tiempo comprendido entre el segundo y el noveno mes inmediatamente anteriores a la correspondiente

Fecha de Pago respecto al saldo nominal pendiente de las Participaciones Hipotecarias

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF;



Nº: 4881/17

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

CAIXA PENEDES 1 TDA\Infoinver.trim\Oct17

CAIXA PENEDES 1 TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 28/07/17-30/10/17

| I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO | |
|--|---|
| Fecha de Constitución del Fondo | 18 de octubre de 2006 |
| Fecha Emisión BTH | 18 de octubre de 2006 |
| Fecha Final Amortización BTH (6,53% TAA) | 29 de abril de 2024 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisor Participaciones Hipotecarias | BMN (Caixa Penedés) y Banco de Sabadell (Caixa Penedés) |
| Agente de Pagos | BNP PARIBAS |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Fitch IBCA; Standard & Poor´s |
| Calificación | Serie A: (F) A+ (sf) / (S&P) BBB+ (sf) Serie B: (F) BBB (sf) / (S&P) B+ (sf) Serie C: (F) BB (sf) / (S&P) B- (sf) |

| II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO | |
|---|--|
| Nombre | Bonos de Titulización CAIXA PENÉDES 1 TDA |
| Serie A: | |
| Código ISIN | ES0313252001 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 950.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 245.679.120,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 25.860,96 Euros |
| Serie B: | |
| Código ISIN | ES0313252019 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 29.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 17.112.914,50 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 59.010,05 Euros |
| Serie C: | |
| Código ISIN | ES0313252027 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 21.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 12.392.110,50 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 59.010,05 Euros |

| III. INFORMACION INCLUIDA |
|--|
| * Liquidación del Período:28/07/17-30/10/17 |
| * Flujos de Caja del Período:28/07/17-30/10/17 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 30 de Octubre de 2017 |

CAIXA PENEDES TDA 1*Fondo de Titulización de Activos***FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 28/07/17 - 30/10/17**

| | Euros | |
|--|----------------------|----------------------|
| | Ingresos | Pagos |
| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | | |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 11.634.030,00 |
| Amortización Participaciones Hip. | 11.562.285,88 | |
| Amortización Ptmos. Subordinados | | 232.680,60 |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 7.419,30 |
| Intereses recibidos de las PHs | 1.364.475,02 | |
| Intereses Ptmos. Subordinados | | 10.035,45 |
| Intereses Inversiones Temporales | -18.028,67 | |
| Intereses Pagados Linea Liquidez | | 0,00 |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: | | 17.200,90 |
| Recursos pendientes de aplicación | | 270.558,77 |
| Neto SWAP | | 332.603,11 |
| Remuneración Variable Préstamo Participativo | | 608.913,97 |
| Total Ingresos/Pagos | 12.908.732,23 | 13.113.442,10 |
| Saldo inicial 28/07/17 | 7.450.999,09 | |
| A Inversiones Temporales | | 7.246.289,22 |
| Total | 20.359.731,32 | 20.359.731,32 |
| Retenciones practicadas el 30/10/17 | 1.409,67 | |
| A Inv.Temporales | | 1.409,67 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 4887/17**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

CAIXA PENEDES 1 TDA\fluj.trim\Oct17