

TDA 24 - Fondo de Titulización de Activos
LIQUIDACION DEL PERIODO 22/06/16 - 22/09/16

	Euros
	TOTAL
I. Situación inicial	29,65
Fondo Reserva	0,00
Cantidad Dotada Línea Liquidez	0,00
Saldo Inial Cuenta Tesorería	29,65
II. Fondos recibidos del emisor	4.450.668,42
Principal:	
Según calendario hasta 31/08/16:	2.337.079,84
Amort. Anticipada hasta 31/08/16:	1.116.265,35
Intereses:	869.323,23
Ingresos por venta de inmuebles	128.000,00
III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):	4.450.698,07
IV. Total intereses de la reinversión:	-3.342,41
Intereses de la Cta. De Tesorería	-1.575,66
Intereses de la Cta. De Cobros	-1.766,75
Intereses de la Cta. De Amortización Línea Liquidez	0,00
V. Recursos disponibles (III + IV):	4.447.355,66
VI. Varios:	223.440,35
VII. Liquidación SWAP:	-652.162,48
Cantidad a Pagar por la Parte A (J P Morgan):	-72.820,94
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	579.341,54
VIII. Línea Liquidez	0,00
Intereses	0,00
Amortización	0,00
IX. Pago a los Bonos:	3.571.752,34
Bonos A1:	
Intereses correspondientes al 22/09/16:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 22/09/16:	3.571.752,34
Bonos A2:	
Intereses correspondientes al 22/09/16:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 22/09/16:	0,00
Bonos B:	
Intereses correspondientes al 22/09/16:	2.898,45
Intereses pagados a 22/09/16:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados a 22/09/16:	273.956,85
Amortización correspondiente al 22/09/16:	0,00
Bonos C:	
Intereses vencidos a 22/09/16:	6.914,16
Intereses pagados a 22/09/16:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados a 22/09/16:	410.123,25
Amortización correspondiente al 22/09/16:	0,00
Bonos D:	
Intereses vencidos a 22/09/16:	22.156,50
Intereses pagados a 22/09/16:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados a 22/09/16:	740.955,50
Amortización correspondiente al 22/09/16:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	0,00
X. Saldo disponible :	0,49
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo 22/06/16:	0,00
Aportación al Fondo de Reserva	0,00
Cantidad Dotada Línea Liquidez 22/09/16	0,00
Recursos para proximo pago	0,49
Margen de Intermediación Financiera	0,00
Fondo de Reserva 22/09/16:	0,00

Destinatarios: CNMV, AIAF



Nº: 4388/16

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
 Oriense, 69
 28020 Madrid
 Tel.:917020808
<http://www.tda-sgft.com>
 TDA24liq.trimSep16

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 22 de Septiembre de 2016

Importes en euros		
I. BONOS A1 ES0377952009		
Sobre 3614 bonos		Por Bono
1. Saldo inicial (01/12/05):	361.400.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	41.384.311,54 €	11.451,11 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	3.571.752,34 €	988,31 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	37.812.559,20 €	10.462,80 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	10,462800%	10,462800%
II. BONOS A2 ES0377952017		
Sobre 970 bonos		Por Bono
1. Saldo inicial (01/12/05):	97.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	69.058.354,60 €	71.194,18 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	69.058.354,60 €	71.194,18 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	71,194180%	71,194180%
III. BONOS B ES0377952025		
Sobre 135 bonos		Por Bono
1. Saldo inicial (01/12/05):	13.500.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	13.500.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	2.898,45 €	21,47 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	273.956,85 €	2.029,31 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	13.500.000,00 €	100.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
IV. BONOS C ES0377952033		
Sobre 81 bonos		Por Bono
1. Saldo inicial (01/12/05):	8.100.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	8.100.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	6.914,16 €	85,36 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	410.123,25 €	5.063,25 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	8.100.000,00 €	100.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
V. BONOS D ES0377952041		
Sobre 50 bonos		Por Bono
1. Saldo inicial (01/12/05):	5.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	5.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	22.156,50 €	443,13 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	740.955,50 €	14.819,11 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	5.000.000,00 €	100.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
VI. EL FONDO		
Importes en euros		
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/08/16:		
a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas:		109.967.279,48 €
b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas:		27.268.972,36 €
c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas:		110.047.245,75 €
d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas:		36.484.832,52 €
2. Amortización del periodo 31/05/16 a 31/08/16:		
a) Según calendario:		3.453.345,19 €
b) Amortización anticipada hasta 31/08/16:		1.116.265,35 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):		
a) Ultimo año:		3,38%
b) Ultimo semestre:		3,13%
c) Ultimo trimestre:		3,87%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:		
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:		
6. Porcentaje de fallidos (1):		
7. Nivel de Impago (2)		

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

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

Destinatarios: Cedentes; CNMV; AIAF,



Nº: 4389/16

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.: 917020808

http://www.tda-sgft.com

TD24InforInv.trimSep16

TDA 24 , FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 22/06/16-22/09/16

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	28 de noviembre de 2005
Fecha Emisión Bonos	28 de noviembre de 2005
Fecha Final Amortización Bonos (3,38% TAA)	22 de junio de 2022
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca	Credifimo, CaixaBank (Bankpime), Banco Castilla-La Mancha
Agente de Pagos	BNP PARIBAS
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Fitch Ibcá
Calificación	Bono A1:(F) B (sf) Bono A2:(F) B (sf) Bono B:(F) CC (sf) Bono C:(F) CC (sf) Bono D:(F) C (sf)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Nombre	Bonos de Titulización TDA 24
Serie A1:	
Código ISIN	ES0377952009
Nominal en circulación total (inicial)	361.400.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	37.812.559,20 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	10.462,80 Euros

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Nombre	Bonos de Titulización TDA 24
Serie A2:	
Código ISIN	ES0377952017
Nominal en circulación total (inicial)	97.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	69.058.354,60 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	71.194,18 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0377952025
Nominal en circulación total (inicial)	13.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	13.500.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie C:	
Código ISIN	ES0377952033
Nominal en circulación total (inicial)	8.100.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	8.100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie D:	
Código ISIN	ES0377952041
Nominal en circulación total (inicial)	5.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	5.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA

- * Liquidación del Período:22/06/16-22/09/16
- * Flujos de Caja del Período:22/06/16-22/09/16
- * Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Septiembre de 2016

TDA 24**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/06/16 - 22/09/16**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip.		3.571.752,34
Amortización Participaciones Hip.	3.453.345,19	
Ingresos por venta de inmuebles	128.000,00	
II. INTERESES		
Intereses pagados línea de liquidez		0,00
Intereses pagados a los BTH		0,00
Intereses recibidos de las PHs	869.323,23	
Intereses Inversiones Temporales	-3.342,41	
III. GASTOS		
Comisiones Periódicas:		223.440,35
Neto SWAP		652.162,48
Margen de Intermediación Financiera		0,00
Total Ingresos/Pagos	4.447.326,01	4.447.355,17
Saldo inicial 22/06/16	29,65	
A Inversiones Temporales		0,49
Total	4.447.355,66	4.447.355,66
Retenciones practicadas el 22/09/16	0,00	
A Inversiones Temporales		0,00

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 4395/16**

Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Oronse, 69

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

TDA 24\flujo.trim\Sep16