

**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: 30/06/2022

**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: 30/06/2022**

| BALANCE (miles de euros)                                |      | Periodo actual<br>30/06/2022 |      | Periodo anterior<br>31/12/2021 |
|---|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>ACTIVO</b>   |      |                              |      |                                |
| <b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>                           | 0001 | 7.394.835                    | 1001 | 8.427.567                      |
| <b>I. Activos financieros a largo plazo</b>             | 0002 | 7.394.835                    | 1002 | 8.427.567                      |
| 1. Activos titulizados                                  | 0003 | 7.394.835                    | 1003 | 8.427.567                      |
| 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 | 7.394.835                    | 1023 | 8.427.567                      |
| 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                              |
| <b>II. Activos por impuesto diferido</b>                | 0039 | 0                            | 1039 | 0                              |
| <b>III. Otros activos no corrientes</b>                 | 0040 | 0                            | 1040 | 0                              |

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: 30/06/2022

| BALANCE (miles de euros)                                   |      | Periodo actual<br>30/06/2022 |      | Periodo anterior<br>31/12/2021 |
|--|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>                                 | 0041 | 2.444.248                    | 1041 | 2.310.333                      |
| <b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>  | 0042 | 0                            | 1042 | 0                              |
| <b>V. Activos financieros a corto plazo</b>                | 0043 | 2.441.873                    | 1043 | 2.307.935                      |
| 1. Activos titulizados                                     | 0044 | 1.932.363                    | 1044 | 1.833.463                      |
| 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 | 1.932.363                    | 1064 | 1.833.463                      |
| 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 | 509.510                      | 1074 | 474.472                        |
| 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 | 509.510                      | 1077 | 474.472                        |
| 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 |                                |
| <b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>                   | 0082 | 0                            | 1082 | 0                              |
| 1. Comisiones  | 0083 | 0                            | 1083 | 0                              |
| 2. Otros   | 0084 | 0                            | 1084 | 0                              |
| <b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b> | 0085 | 2.375                        | 1085 | 2.399                          |
| 1. Tesorería   | 0086 | 2.375                        | 1086 | 2.399                          |
| 2. Otros activos líquidos equivalentes                     | 0087 | 0                            | 1087 | 0                              |
| <b>TOTAL ACTIVO</b>  | 0088 | 9.839.082                    | 1088 | 10.737.901                     |

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: 30/06/2022

| BALANCE (miles de euros)                                  |      | Periodo actual<br>30/06/2022 |      | Periodo anterior<br>31/12/2021 |
|---|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>PASIVO</b>   |      |                              |      |                                |
| <b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>                             | 0089 | 7.294.608                    | 1089 | 9.143.556                      |
| <b>I. Provisiones a largo plazo</b>                       | 0090 | 489.711                      | 1090 | 459.163                        |
| 1. Provisión garantías financieras                        | 0091 | 0                            | 1091 | 0                              |
| 2. Provisión por margen de intermediación                 | 0092 | 489.711                      | 1092 | 459.163                        |
| 3. Otras provisiones                                      | 0093 | 0                            | 1093 | 0                              |
| <b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>              | 0094 | 6.804.897                    | 1094 | 8.684.393                      |
| 1. Obligaciones y otros valores emitidos                  | 0095 | 5.763.084                    | 1095 | 8.173.754                      |
| 1.1 Series no subordinadas                                | 0096 | 5.763.084                    | 1096 | 8.173.754                      |
| 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 | 1.041.812                    | 1101 | 510.639                        |
| 2.1 Préstamo subordinado                                  | 0102 | 0                            | 1102 | 0                              |
| 2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta                   | 0103 | 1.041.812                    | 1103 | 510.639                        |
| 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                              |
| <b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>                 | 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: 30/06/2022**

| BALANCE (miles de euros)   |      | Periodo actual<br>30/06/2022 |      | Periodo anterior<br>31/12/2021 |
|--|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>B) PASIVO CORRIENTE</b>   | 0117 | 2.544.475                    | 1117 | 1.594.345                      |
| <b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b> | 0118 | 0                            | 1118 | 0                              |
| <b>V. Provisiones a corto plazo</b>  | 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                              |
| <b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>                                     | 0123 | 2.542.042                    | 1123 | 1.591.844                      |
| 1. Obligaciones y otros valores emitidos   | 0124 | 2.542.042                    | 1124 | 1.591.844                      |
| 1.1 Series no subordinadas   | 0125 | 2.498.534                    | 1125 | 1.497.131                      |
| 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 | 43.508                       | 1128 | 94.713                         |
| 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                              |
| <b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>  | 0148 | 2.433                        | 1148 | 2.501                          |
| 1. Comisiones  | 0149 | 16                           | 1149 | 20                             |
| 1.1 Comisión sociedad gestora  | 0150 | 3                            | 1150 | 3                              |
| 1.2 Comisión administrador   | 0151 | 0                            | 1151 | 0                              |
| 1.3 Comisión agente financiero/pagos   | 0152 | 13                           | 1152 | 17                             |
| 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 | 2.417                        | 1157 | 2.481                          |
| <b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>       | 0158 | 0                            | 1158 | 0                              |
| <b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>                       | 0159 | 0                            | 1159 | 0                              |
| <b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>                                      | 0160 | 0                            | 1160 | 0                              |
| <b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>                 | 0161 | 0                            | 1161 | 0                              |
| <b>TOTAL PASIVO</b>  | 0162 | 9.839.082                    | 1162 | 10.737.901                     |

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: 30/06/2022

| CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)                              |      | P. corriente actual (2. trimestre) |      | P. corriente anterior (2. trimestre) |      | Acumulado actual 30/06/2022 |      | Acumulado anterior 30/06/2021 |
|--|------|------------------------------------|------|--------------------------------------|------|-----------------------------|------|-------------------------------|
| <b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>                                | 0201 | 51.194                             | 1201 | 54.366                               | 2201 | 104.373                     | 3201 | 132.469                       |
| 1.1 Activos titulizados  | 0202 | 51.194                             | 1202 | 54.366                               | 2202 | 104.373                     | 3202 | 132.469                       |
| 1.2 Otros activos financieros  | 0203 | 0                                  | 1203 | 0                                    | 2203 | 0                           | 3203 | 0                             |
| <b>2. Intereses y cargas asimilados</b>                                      | 0204 | -35.848                            | 1204 | -38.226                              | 2204 | -72.865                     | 3204 | -107.658                      |
| 2.1 Obligaciones y otros valores emitidos                                    | 0205 | -34.546                            | 1205 | -36.536                              | 2205 | -70.987                     | 3205 | -105.700                      |
| 2.2 Deudas con entidades de crédito  | 0206 | -1.302                             | 1206 | -1.690                               | 2206 | -1.878                      | 3206 | -1.959                        |
| 2.3 Otros pasivos financieros  | 0207 | 0                                  | 1207 | 0                                    | 2207 | 0                           | 3207 | 0                             |
| <b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b> | 0208 | 0                                  | 1208 | 0                                    | 2208 | 0                           | 3208 | 0                             |
| <b>A) MARGEN DE INTERESES</b>  | 0209 | 15.347                             | 1209 | 16.140                               | 2209 | 31.508                      | 3209 | 24.810                        |
| <b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>                        | 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                             |
| <b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>                                       | 0215 | 0                                  | 1215 | 0                                    | 2215 | 0                           | 3215 | 0                             |
| <b>6. Otros ingresos de explotación</b>                                      | 0216 | 0                                  | 1216 | 0                                    | 2216 | 0                           | 3216 | 0                             |
| <b>7. Otros gastos de explotación</b>  | 0217 | -345                               | 1217 | -245                                 | 2217 | -960                        | 3217 | -1.070                        |
| 7.1 Servicios exteriores   | 0218 | -229                               | 1218 | -107                                 | 2218 | -718                        | 3218 | -774                          |
| 7.1.1 Servicios de profesionales independientes                              | 0219 | -1                                 | 1219 | -1                                   | 2219 | -43                         | 3219 | -43                           |
| 7.1.2 Servicios bancarios y similares  | 0220 | -228                               | 1220 | -106                                 | 2220 | -675                        | 3220 | -731                          |
| 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 | -116                               | 1224 | -138                                 | 2224 | -243                        | 3224 | -296                          |
| 7.3.1 Comisión sociedad gestora  | 0225 | -19                                | 1225 | -22                                  | 2225 | -40                         | 3225 | -50                           |
| 7.3.2 Comisión administrador   | 0226 | 0                                  | 1226 | 0                                    | 2226 | 0                           | 3226 | 0                             |
| 7.3.3 Comisión agente financiero/pagos                                       | 0227 | -97                                | 1227 | -111                                 | 2227 | -202                        | 3227 | -242                          |
| 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 | -4                                   | 2230 | 0                           | 3230 | -4                            |
| <b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>                            | 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                             |
| <b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>                                    | 0234 | -15.002                            | 1234 | -15.895                              | 2234 | -30.548                     | 3234 | -23.740                       |
| 9.1 Dotación provisión por garantías financieras                             | 0235 | 0                                  | 1235 | 0                                    | 2235 | 0                           | 3235 | 0                             |
| 9.2 Dotación provisión por margen de intermediación                          | 0236 | -15.002                            | 1236 | -15.895                              | 2236 | -30.548                     | 3236 | -23.740                       |
| 9.3 Dotación otras provisiones   | 0237 | 0                                  | 1237 | 0                                    | 2237 | 0                           | 3237 | 0                             |
| <b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>            | 0238 | 0                                  | 1238 | 0                                    | 2238 | 0                           | 3238 | 0                             |
| <b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>                               | 0239 | 0                                  | 1239 | 0                                    | 2239 | 0                           | 3239 | 0                             |
| <b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>                                       | 0240 | 0                                  | 1240 | 0                                    | 2240 | 0                           | 3240 | 0                             |
| <b>12. Impuesto sobre beneficios</b>   | 0241 | 0                                  | 1241 | 0                                    | 2241 | 0                           | 3241 | 0                             |
| <b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>  | 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: 30/06/2022

| ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)                                    |      | P. corriente actual (2. trimestre) |      | P. corriente anterior (2. trimestre) |      | Acumulado actual 30/06/2022 |      | Acumulado anterior 30/06/2021 |
|--|------|------------------------------------|------|--------------------------------------|------|-----------------------------|------|-------------------------------|
| <b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>                          | 0300 | 11.585                             | 1300 | 26.189                               | 2300 | -21.157                     | 3300 | -120.623                      |
| <b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>                    | 0301 | 11.921                             | 1301 | 26.393                               | 2301 | -20.202                     | 3301 | -119.516                      |
| 1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados                                | 0302 | 30.748                             | 1302 | 45.660                               | 2302 | 104.759                     | 3302 | 161.817                       |
| 1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos              | 0303 | -17.389                            | 1303 | -17.389                              | 2303 | -123.060                    | 3303 | -279.351                      |
| 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 | -1.302                             | 1307 | -1.690                               | 2307 | -1.878                      | 3307 | -1.959                        |
| 1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)                                      | 0308 | -136                               | 1308 | -188                                 | 2308 | -23                         | 3308 | -24                           |
| <b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>                  | 0309 | -337                               | 1309 | -204                                 | 2309 | -955                        | 3309 | -1.107                        |
| 2.1 Comisión sociedad gestora  | 0310 | -19                                | 1310 | -23                                  | 2310 | -41                         | 3310 | -51                           |
| 2.2 Comisión administrador   | 0311 | 0                                  | 1311 | 0                                    | 2311 | 0                           | 3311 | 0                             |
| 2.3 Comisión agente financiero/pagos   | 0312 | -98                                | 1312 | -112                                 | 2312 | -205                        | 3312 | -248                          |
| 2.4 Comisión variable  | 0313 | 0                                  | 1313 | 0                                    | 2313 | 0                           | 3313 | 0                             |
| 2.5 Otras comisiones   | 0314 | -219                               | 1314 | -69                                  | 2314 | -709                        | 3314 | -809                          |
| <b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>        | 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>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>                 | 0322 | -11.721                            | 1322 | -26.438                              | 2322 | 21.134                      | 3322 | -628.358                      |
| <b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>            | 0323 | 0                                  | 1323 | 0                                    | 2323 | 0                           | 3323 | 0                             |
| <b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>                  | 0324 | 0                                  | 1324 | 0                                    | 2324 | 0                           | 3324 | 0                             |
| <b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b> | 0325 | 201.093                            | 1325 | 468.280                              | 2325 | -509.990                    | 3325 | -1.778.700                    |
| 6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados                     | 0326 | 475.493                            | 1326 | 468.280                              | 2326 | 898.410                     | 3326 | 870.300                       |
| 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 | -274.400                           | 1331 | 0                                    | 2331 | -1.408.400                  | 3331 | -2.649.000                    |
| <b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>                     | 0332 | -212.814                           | 1332 | -494.718                             | 2332 | 531.124                     | 3332 | 1.150.342                     |
| 7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito                      | 0333 | 292.125                            | 1333 | 17.593                               | 2333 | 1.532.414                   | 3333 | 1.835.559                     |
| 7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito                       | 0334 | -504.932                           | 1334 | -512.245                             | 2334 | -1.001.241                  | 3334 | -685.109                      |
| 7.3 Pagos a Administraciones públicas  | 0335 | 0                                  | 1335 | 0                                    | 2335 | 0                           | 3335 | 0                             |
| 7.4 Otros cobros y pagos   | 0336 | -8                                 | 1336 | -66                                  | 2336 | -50                         | 3336 | -109                          |
| <b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>              | 0337 | -136                               | 1337 | -249                                 | 2337 | -24                         | 3337 | -748.981                      |
| Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo                                  | 0338 | 2.511                              | 1338 | 2.628                                | 2338 | 2.399                       | 3338 | 751.359                       |
| Efectivo o equivalentes al final del periodo                                     | 0339 | 2.375                              | 1339 | 2.379                                | 2339 | 2.375                       | 3339 | 2.379                         |

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: 30/06/2022

| INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)   |             | P. corriente actual (2. trimestre) |             | P. corriente anterior (2. trimestre) |             | Acumulado actual 30/06/2022 |             | Acumulado anterior 30/06/2021 |
|--|-------------|------------------------------------|-------------|--------------------------------------|-------------|-----------------------------|-------------|-------------------------------|
| <b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>  |             |                                    |             |                                      |             |                             |             |                               |
| 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                             |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>                   | <b>0356</b> | <b>0</b>                           | <b>1356</b> | <b>0</b>                             | <b>2356</b> | <b>0</b>                    | <b>3356</b> | <b>0</b>                      |
| <b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>  |             |                                    |             |                                      |             |                             |             |                               |
| 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                             |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>  | <b>0363</b> | <b>0</b>                           | <b>1363</b> | <b>0</b>                             | <b>2363</b> | <b>0</b>                    | <b>3363</b> | <b>0</b>                      |
| <b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>   |             |                                    |             |                                      |             |                             |             |                               |
| 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                             |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>  | <b>0369</b> | <b>0</b>                           | <b>1369</b> | <b>0</b>                             | <b>2369</b> | <b>0</b>                    | <b>3369</b> | <b>0</b>                      |
| <b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>  | <b>0370</b> | <b>0</b>                           | <b>1370</b> | <b>0</b>                             | <b>2370</b> | <b>0</b>                    | <b>3370</b> | <b>0</b>                      |



**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: 30/06/2022**

**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 30/06/2022 |                 |                               |                                 | Situación cierre anual anterior 31/12/2021 |                 |                               |                                 | 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: 30/06/2022

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        |
| <b>Total</b>                     | <b>0466</b>   | <b>0</b> | <b>0473</b>                 | <b>0</b> | <b>0480</b>                          | <b>0</b> | <b>0487</b>                             | <b>0</b> | <b>0494</b> | <b>0</b> | <b>0501</b>                    | <b>0</b>       | <b>0508</b> | <b>0</b>    | <b>1515</b> | <b>0</b> |

| 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        |
| <b>Total</b>                                 | <b>0521</b>   | <b>0</b> | <b>0528</b>                 | <b>0</b> | <b>0535</b>                          | <b>0</b> | <b>0542</b>                             | <b>0</b> | <b>0549</b> | <b>0</b> | <b>0556</b>                    | <b>0</b>       | <b>0563</b> | <b>0</b>    | <b>0570</b> | <b>0</b>       | <b>0577</b> | <b>0</b>                             |      |                       | <b>0590</b> | <b>0,00</b> |

**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: 30/06/2022**

**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 30/06/2022 |                  | Situación cierre anual anterior 31/12/2021 |                   | 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                        | 3.086.599        | 1603                                       | 0                 | 2603                         | 0                 |
| Entre 4 y 5 años  | 0604                        | 2.137.347        | 1604                                       | 3.478.905         | 2604                         | 0                 |
| Entre 5 y 10 años   | 0605                        | 4.103.252        | 1605                                       | 6.782.125         | 2605                         | 0                 |
| Superior a 10 años  | 0606                        | 0                | 1606                                       | 0                 | 2606                         | 24.189.838        |
| <b>Total</b>  | 0607                        | <b>9.327.198</b> | 1607                                       | <b>10.261.030</b> | 2607                         | <b>24.189.838</b> |
| <b>Vida residual media ponderada (años)</b>               | 0608                        | <b>4,94</b>      | 1608                                       | <b>5,43</b>       | 2608                         | <b>14,94</b>      |

| Antigüedad                        | Situación actual 30/06/2022 |      | Situación cierre anual anterior 31/12/2021 |      | Situación inicial 23/11/2010 |      |
|-----------------------------------|-----------------------------|------|--|------|------------------------------|------|
| Antigüedad media ponderada (años) | 0609                        | 9,88 | 1609                                       | 9,40 | 2609                         | 0,00 |

**FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC**

|  |
|--|
| <b>S.05.1</b>  |
| <b>Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC</b>  |
| <b>Denominación del compartimento:</b>   |
| <b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>   |
| <b>Estados agregados: NO</b>   |
| <b>Fecha: 30/06/2022</b>   |
| <b>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</b> |

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO D**

| Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros) | Situación actual 30/06/2022 |             |                     |          | Situación cierre anual anterior 31/12/2021 |             |                     |          | 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        |
| <b>Total</b>  | 0628                        | <b>0</b>    | 0638                | <b>0</b> | 1628                                       | <b>0</b>    | 1638                | <b>0</b> | 2628                         | <b>0</b>    | 2638                | <b>0</b> |
| <b>Media ponderada (%)</b>  | 0639                        | <b>0,00</b> | 0649                |          | 1639                                       | <b>0,00</b> | 1649                |          | 2639                         | <b>0,00</b> | 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: 30/06/2022**

**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<br>30/06/2022 |      | Situación cierre anual anterior<br>31/12/2021 |      | Situación inicial 23/11/2010 |      |
|---|--------------------------------|------|---|------|------------------------------|------|
|   |                                |      |   |      |                              |      |
| Tipo de interés medio ponderado                 | 0650                           | 2,22 | 1650  | 2,56 | 2650                         | 4,83 |
| Tipo de interés nominal máximo                  | 0651                           | 1,87 | 1651  | 2,56 | 2651                         | 8,11 |
| Tipo de interés nominal mínimo                  | 0652                           | 1,87 | 1652  | 2,56 | 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: 30/06/2022

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 30/06/2022 |           |                     |                  | Situación cierre anual anterior 31/12/2021 |           |                     |                   | 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                | 9.327.198        | 1672                                       | 43        | 1695                | 10.261.030        | 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                 |
| <b>Total España</b>  | 0679                        | <b>43</b> | 0702                | <b>9.327.198</b> | 1679                                       | <b>43</b> | 1702                | <b>10.261.030</b> | 2679                         | <b>43</b> | 2702                | <b>24.189.838</b> |
| 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                 |
| <b>Total general</b>   | 0682                        | <b>43</b> | 0705                | <b>9.327.198</b> | 1682                                       | <b>43</b> | 1705                | <b>10.261.030</b> | 2682                         | <b>43</b> | 2705                | <b>24.189.838</b> |

**FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC**

|  |
|--|
| <b>S.05.1</b>  |
| <b>Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC</b>  |
| <b>Denominación del compartimento:</b>   |
| <b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>   |
| <b>Estados agregados: NO</b>   |
| <b>Fecha: 30/06/2022</b>   |
| <b>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</b> |

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

| Concentración   | Situación actual 30/06/2022 |        |      |    | Situación cierre anual anterior 31/12/2021 |        |      |    | 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: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO A**

| (miles de euros) |                    | Situación actual 30/06/2022 |                      |                     | Situación cierre anual anterior 31/12/2021 |                      |                     | 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            | 0                           | 0                    | 0                   | 0  | 0                    | 0                   | 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                   | 0  | 0                    | 0                   | 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                   | 0  | 0                    | 0                   | 20.100                       | 100.000              | 2.010.000           |
| ES0378641213     | Serie 22           | 0                           | 0                    | 0                   | 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           | 0                           | 0                    | 0                   | 0  | 0                    | 0                   | 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           | 0                           | 0                    | 0                   | 0  | 0                    | 0                   | 3.200                        | 100.000              | 320.000             |



**FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC**

|              |          |        |         |           |           |         |           |        |           |           |         |      |            |
|--------------|----------|--------|---------|-----------|-----------|---------|-----------|--------|-----------|-----------|---------|------|------------|
| ES0378641262 | Serie 27 | 0      | 0       | 0         | 0         | 0       | 0         | 700    | 100.000   | 70.000    |         |      |            |
| ES0378641270 | Serie 28 | 4.580  | 100.000 | 458.000   | 4.580     | 100.000 | 458.000   | 4.580  | 100.000   | 458.000   |         |      |            |
| ES0378641288 | Serie 29 | 0      | 0       | 0         | 11.340    | 100.000 | 1.134.000 | 11.340 | 100.000   | 1.134.000 |         |      |            |
| ES0378641296 | Serie 30 | 0      | 0       | 0         | 0         | 0       | 0         | 1.407  | 100.000   | 140.700   |         |      |            |
| ES0378641304 | Serie 31 | 0      | 0       | 0         | 0         | 0       | 0         | 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 | 10.000    | 100.000 | 1.000.000 | 10.000 | 100.000   | 1.000.000 |         |      |            |
| ES0378641346 | Serie 35 | 10.000 | 100.000 | 1.000.000 | 10.000    | 100.000 | 1.000.000 | 10.000 | 100.000   | 1.000.000 |         |      |            |
| ES0378641353 | Serie 36 | 12.000 | 100.000 | 1.200.000 | 12.000    | 100.000 | 1.200.000 | 12.000 | 100.000   | 1.200.000 |         |      |            |
| <b>Total</b> |          | 0723   | 82.678  | 0724      | 8.267.800 | 1723    | 96.762    | 1724   | 9.676.200 | 2723      | 403.359 | 2724 | 40.335.900 |

**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: 30/06/2022

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                 | 0737               |                 |   |
|                  |                    | 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   | 0,00          | 0                    | 0                   | NO                                    | 0                    | 0                  | 0               | 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          | 5.342                | 0                   | NO                                    | 200.000              | 0                  | 205.342         | 0   |
| ES0378641064     | Serie 7            | NS                     | Tipo Fijo            | 0,00   | 5,00          | 223                  | 0                   | NO                                    | 125.000              | 0                  | 125.223         | 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          | 10.946               | 0                   | NO                                    | 608.800              | 0                  | 619.746         | 0   |
| ES0378641098     | Serie 10           | NS                     | Tipo Fijo            | 0,00   | 6,46          | 11.931               | 0                   | NO                                    | 642.000              | 0                  | 653.931         | 0   |
| ES0378641106     | Serie 11           | NS                     | Tipo Fijo            | 0,00   | 6,50          | 2.337                | 0                   | NO                                    | 125.000              | 0                  | 127.337         | 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          | 2.734                | 0                   | NO                                    | 89.000               | 0                  | 91.734          | 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   | 0,00          | 0                    | 0                   | NO                                    | 0                    | 0                  | 0               | 0   |
| ES0378641221     | Serie 23           | NS                     | Tipo Fijo            | 0,00   | 1,80          | 77                   | 0                   | NO                                    | 120.000              | 0                  | 120.077         | 0   |
| ES0378641239     | Serie 24           | NS                     | Tipo Fijo            | 0,00   | 0,00          | 0                    | 0                   | NO                                    | 0                    | 0                  | 0               | 0   |
| ES0378641247     | Serie 26           | NS                     | Tipo Fijo            | 0,00   | 1,00          | 1.567                | 0                   | NO                                    | 200.000              | 0                  | 201.567         | 0   |

**FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC**

|              |          |    |           |      |      |       |        |      |           |      |           |      |   |      |           |      |   |
|--------------|----------|----|-----------|------|------|-------|--------|------|-----------|------|-----------|------|---|------|-----------|------|---|
| ES0378641254 | Serie 25 | NS | Tipo Fijo | 0,00 | 0,00 | 0     | 0      | NO   | 0         | 0    | 0         | 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 | 988   | 0      | NO   | 458.000   | 0    | 458.988   | 0    |   |      |           |      |   |
| ES0378641288 | Serie 29 | NS | Tipo Fijo | 0,00 | 0,00 | 0     | 0      | NO   | 0         | 0    | 0         | 0    |   |      |           |      |   |
| ES0378641296 | Serie 30 | NS | Tipo Fijo | 0,00 | 0,00 | 0     | 0      | NO   | 0         | 0    | 0         | 0    |   |      |           |      |   |
| ES0378641304 | Serie 31 | NS | Tipo Fijo | 0,00 | 0,00 | 0     | 0      | NO   | 0         | 0    | 0         | 0    |   |      |           |      |   |
| ES0378641312 | Serie 32 | NS | Tipo Fijo | 0,00 | 0,50 | 2.158 | 0      | NO   | 1.500.000 | 0    | 1.502.158 |      |   |      |           |      |   |
| ES0378641320 | Serie 33 | NS | Tipo Fijo | 0,00 | 0,85 | 4.541 | 0      | NO   | 1.000.000 | 0    | 1.004.541 |      |   |      |           |      |   |
| ES0378641338 | Serie 34 | NS | Tipo Fijo | 0,00 | 0,50 | 178   | 0      | NO   | 1.000.000 | 0    | 1.000.178 |      |   |      |           |      |   |
| ES0378641346 | Serie 35 | NS | Tipo Fijo | 0,00 | 0,05 | 392   | 0      | NO   | 1.000.000 | 0    | 1.000.392 |      |   |      |           |      |   |
| ES0378641353 | Serie 36 | NS | Tipo Fijo | 0,00 | 0,01 | 94    | 0      | NO   | 1.200.000 | 0    | 1.200.094 |      |   |      |           |      |   |
| <b>Total</b> |          |    |           |      |      | 0740  | 43.508 | 0741 | 0         | 0743 | 8.267.800 | 0744 | 0 | 0745 | 8.311.308 | 0746 | 0 |

|  | Situación actual 30/06/2022 |      | Situación cierre anual anterior 31/12/2021 |      | Situación inicial 23/11/2010 |      |
|--|-----------------------------|------|--|------|------------------------------|------|
| Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%) | 0747                        | 1,60 | 0748                                       | 1,23 | 0749                         | 3,12 |

**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: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO C**

| (miles de euros) |                    | Situación actual 30/06/2022 |                  |                   |                  | Situación periodo comparativo anterior 30/06/2021 |                  |                   |                  |
|------------------|--------------------|-----------------------------|------------------|-------------------|------------------|---|------------------|-------------------|------------------|
| 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                           | 2.649.000        | 0                 | 1.500.565        | 0   | 2.649.000        | 0                 | 1.500.565        |
| 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                | 0                 | 96.660           | 0   | 0                | 0                 | 86.660           |
| ES0378641064     | Serie 7            | 0                           | 0                | 6.250             | 65.659           | 0   | 0                | 6.250             | 59.409           |
| ES0378641072     | Serie 8            | 0                           | 200.000          | 0                 | 19.378           | 0   | 200.000          | 0                 | 19.378           |
| ES0378641080     | Serie 9            | 0                           | 0                | 0                 | 353.333          | 0   | 0                | 0                 | 315.283          |
| ES0378641098     | Serie 10           | 0                           | 0                | 0                 | 401.373          | 0   | 0                | 0                 | 359.900          |
| ES0378641106     | Serie 11           | 0                           | 0                | 0                 | 81.672           | 0   | 0                | 0                 | 73.547           |
| 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                | 0                 | 45.230           | 0   | 0                | 0                 | 40.113           |
| 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   | 2.125.000        | 0                 | 390.818          |
| 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   | 2.010.000        | 0                 | 71.367           |
| ES0378641213     | Serie 22           | 274.400                     | 274.400          | 3.979             | 23.525           | 0   | 0                | 3.979             | 19.546           |
| ES0378641221     | Serie 23           | 0                           | 0                | 2.160             | 13.096           | 0   | 0                | 2.160             | 10.936           |
| ES0378641239     | Serie 24           | 0                           | 1.016.000        | 0                 | 22.659           | 0   | 1.016.000        | 0                 | 22.659           |
| ES0378641247     | Serie 26           | 0                           | 0                | 0                 | 9.858            | 0   | 0                | 0                 | 7.858            |

**FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC**

|              |          |      |           |       |            |      |           |       |           |      |   |      |            |      |        |      |           |
|--------------|----------|------|-----------|-------|------------|------|-----------|-------|-----------|------|---|------|------------|------|--------|------|-----------|
| ES0378641254 | Serie 25 | 0    | 320.000   | 0     | 1.972      | 0    | 0         | 0     | 1.572     |      |   |      |            |      |        |      |           |
| ES0378641262 | Serie 27 | 0    | 70.000    | 0     | 0          | 0    | 70.000    | 0     | 0         |      |   |      |            |      |        |      |           |
| ES0378641270 | Serie 28 | 0    | 0         | 0     | 15.726     | 0    | 0         | 0     | 12.291    |      |   |      |            |      |        |      |           |
| ES0378641288 | Serie 29 | 0    | 1.134.000 | 0     | 36.037     | 0    | 0         | 0     | 28.949    |      |   |      |            |      |        |      |           |
| ES0378641296 | Serie 30 | 0    | 140.700   | 0     | 538        | 0    | 140.700   | 0     | 538       |      |   |      |            |      |        |      |           |
| ES0378641304 | Serie 31 | 0    | 1.120.000 | 0     | 1.042      | 0    | 1.120.000 | 0     | 1.042     |      |   |      |            |      |        |      |           |
| ES0378641312 | Serie 32 | 0    | 0         | 0     | 30.740     | 0    | 0         | 0     | 23.240    |      |   |      |            |      |        |      |           |
| ES0378641320 | Serie 33 | 0    | 0         | 0     | 26.781     | 0    | 0         | 0     | 18.281    |      |   |      |            |      |        |      |           |
| ES0378641338 | Serie 34 | 0    | 0         | 5.000 | 17.000     | 0    | 0         | 5.000 | 12.000    |      |   |      |            |      |        |      |           |
| ES0378641346 | Serie 35 | 0    | 0         | 0     | 992        | 0    | 0         | 0     | 492       |      |   |      |            |      |        |      |           |
| ES0378641353 | Serie 36 | 0    | 0         | 0     | 145        | 0    | 0         | 0     | 25        |      |   |      |            |      |        |      |           |
| <b>Total</b> |          | 0754 | 274.400   | 0755  | 32.068.100 | 0756 | 17.389    | 0757  | 6.648.958 | 1754 | 0 | 1755 | 30.339.700 | 1756 | 17.389 | 1757 | 6.499.261 |

**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: 30/06/2022**

**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 30/06/2022 | Situación cierre anual anterior 31/12/2021 | Situación inicial 23/11/2010 |
|              |                    |  |  | 0760                        | 0761                                       | 0762                         |
| 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    | A       |
| ES0378641338 | Serie 34 | 22/01/2019 | FCH  | A-   | A-   | A-      |
| ES0378641338 | Serie 34 | 20/09/2019 | SYP  | A    | A    | A-      |
| ES0378641346 | Serie 35 | 23/09/2019 | DBRS | A    | A    | A       |
| ES0378641346 | Serie 35 | 23/09/2019 | FCH  | A-   | A-   | A-      |
| ES0378641346 | Serie 35 | 24/09/2019 | SYP  | A    | A    | A-      |
| ES0378641353 | Serie 36 | 03/07/2020 | FCH  | A-   | A-   | A-      |
| ES0378641353 | Serie 36 | 03/07/2020 | SYP  | A    | A    | A       |



**FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC**

|   |
|---|
| <b>S.05.2</b>   |
| <b>Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC</b> |
| <b>Denominación del compartimento:</b>  |
| <b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>        |
| <b>Estados agregados: NO</b>  |
| <b>Periodo de la declaración: 30/06/2022</b>                                  |
| <b>Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF</b>                   |

**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 30/06/2022 |                  | Situación cierre anual anterior 31/12/2021 |                  | Situación inicial 23/11/2010 |                   |
| Inferior a 1 año   | 0765                        | 2.500.000        | 1765                                       | 1.408.400        | 2765                         |                   |
| Entre 1 y 2 años   | 0766                        | 1.458.000        | 1766                                       | 3.500.000        | 2766                         | 2.585.000         |
| Entre 2 y 3 años   | 0767                        | 1.608.800        | 1767                                       | 1.458.000        | 2767                         | 1.360.700         |
| Entre 3 y 4 años   | 0768                        | 1.570.000        | 1768                                       | 1.808.800        | 2768                         | 11.470.000        |
| Entre 4 y 5 años   | 0769                        | 1.131.000        | 1769                                       | 859.000          | 2769                         | 9.959.400         |
| Entre 5 y 10 años  | 0770                        | 0                | 1770                                       | 642.000          | 2770                         | 13.167.500        |
| Superior a 10 años   | 0771                        |                  | 1771                                       |                  | 2771                         | 1.793.300         |
| <b>Total</b>   | <b>0772</b>                 | <b>8.267.800</b> | <b>1772</b>                                | <b>9.676.200</b> | <b>2772</b>                  | <b>40.335.900</b> |
| <b>Vida residual media ponderada (años)</b>  | <b>0773</b>                 | <b>2,25</b>      | <b>1773</b>                                | <b>2,39</b>      | <b>2773</b>                  | <b>5,13</b>       |

**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: 30/06/2022**

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

| Información sobre las mejoras crediticias del Fondo  | Situación actual 30/06/2022 |                                   | Situación cierre anual anterior 31/12/2021 |                                   | Situación inicial 23/11/2010 |                                   |
|--|-----------------------------|-----------------------------------|--|-----------------------------------|------------------------------|-----------------------------------|
|  | Código                      | Valor                             | Código                                     | Valor                             | Código                       | Valor                             |
| 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                        | 958.188                           | 1781                                       | 1.489.361                         | 2781                         | 2.000.000                         |
| 2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%) | 0782                        | 11,59                             | 1782                                       | 15,39                             | 2782                         | 4,96                              |
| 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                        | 8.267.800                         | 1786                                       | 9.676.200                         | 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                         | 64,46                             |
| 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: 30/06/2022

**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 30/06/2022      | Situación cierre anual anterior 31/12/2021 | 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: 30/06/2022

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

| GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS<br>Naturaleza riesgo cubierto | Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros) |  |   |  |                              |  | Valor en libros (miles de euros) |  |   |  |                              |  | Otras características |  |
|--|---|--|---|--|------------------------------|--|----------------------------------|--|---|--|------------------------------|--|-----------------------|--|
|  | Situación actual<br>30/06/2022                      |  | Situación cierre anual<br>anterior 31/12/2021 |  | Situación inicial 23/11/2010 |  | Situación actual 30/06/2022      |  | Situación cierre anual<br>anterior 31/12/2021 |  | 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                         |  |                       |  |
| <b>Total</b>   | 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: 30/06/2022

**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 30/06/2022 |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2021 |  | Situación actual 30/06/2022 |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2021 |  |              |  | 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 30/06/2022 |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2021 |  |              |  | 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: 30/06/2022

**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: 30/06/2022

**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**

|   |
|---|
| <b>S.05.5</b>   |
| <b>Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC</b> |
| <b>Denominación del compartimento:</b>  |
| <b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>        |
| <b>Estados agregados: NO</b>  |
| <b>Fecha: 30/06/2022</b>  |

**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 |  |  |
|---|-------------|---------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|-------|--|--|
| <b>Ingresos y gastos del periodo de cálculo</b>   | 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        |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |  |
| <b>Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)</b> | <b>0878</b> |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |  |
| 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**

|   |
|---|
| <b>S.05.5</b>   |
| <b>Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC</b> |
| <b>Denominación del compartimento:</b>  |
| <b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>        |
| <b>Estados agregados: NO</b>  |
| <b>Fecha: 30/06/2022</b>  |

**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: 30/06/2022

**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**