

TDA 15-MIXTO - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 22/06/18 - 24/09/18

	EUROS		
	TOTAL GRUPO1	TOTAL GRUPO2	TOTAL FONDO
I. Situación al 22/06/18:	2.399.415,87	2.930.137,44	5.329.553,31
Saldo inicial Cta. Tesorería	2.399.415,87	2.930.137,44	5.329.553,31
II. Fondos recibidos del emisor	913.812,04	1.110.821,34	2.024.633,38
Principal:			
Según calendario hasta 31/08/18:	750.005,01	742.869,57	1.492.874,58
Amort. Anticipada hasta 31/07/18:	48.172,81	223.143,74	271.316,55
Amort. Anticipada último mes:	61.210,02	30.999,26	92.209,28
Intereses:	57.091,95	115.923,41	173.015,36
Avance técnico neto (1):	-2.667,75	-2.114,64	-4.782,39
III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):	3.313.227,91	4.040.958,78	7.354.186,69
IV. Intereses de Reinversión:	-2.757,38	-3.429,71	-6.187,09
Intereses Cta. Tesorería	-1.409,81	-2.997,38	-4.407,19
Intereses Cta. Reinversión	-1.347,57	-432,33	-1.779,90
V. Recursos disponibles (III + IV):	3.310.470,53	4.037.529,07	7.347.999,60
VI. Gastos:	3.380,20	4.476,71	7.856,91
VII. Pago a los Bonos:	890.886,84	1.009.832,90	1.900.719,74
Bonos A1:			
Intereses correspondientes al 24/09/18:	0,00	0,00	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00	0,00	0,00
Amortización correspondiente al 24/09/18:	882.775,74	0,00	882.775,74
Bonos B1:			
Intereses correspondientes al 24/09/18:	8.111,10	0,00	8.111,10
Retenciones practicadas a los bonos:	1.541,11	0,00	1.541,11
Amortización correspondiente al 24/09/18:	0,00	0,00	0,00
Bonos A2:			
Intereses correspondientes al 24/09/18:	0,00	0,00	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00	0,00	0,00
Amortización correspondiente al 24/09/18:	0,00	999.843,44	999.843,44
Bonos B2:			
Intereses correspondientes al 24/09/18:	0,00	9.989,46	9.989,46
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00	1.898,00	1.898,00
Amortización correspondiente al 24/09/18:	0,00	0,00	0,00
Reinversión de las retenciones:	-1.541,11	-1.898,00	-3.439,11
VIII. Saldo disponible (V - VI - VII):	2.416.203,49	3.023.219,46	5.439.422,95
Distribución del saldo disponible:			
Fondo de Reserva 22/06/18:	2.384.000,00	2.868.750,00	5.252.750,00
Aportación al Fondo de Reserva	-28.703,28	0,00	-28.703,28
Otros recursos disponibles para el siguiente pago	60.906,77	25.090,64	85.997,41
Intereses pagados Préstamo Participativo	0,00	5.071,15	5.071,15
Amortización Préstamo Participativo	0,00	0,00	0,00
Remuneración variable prést.participativo	0,00	124.307,67	124.307,67
Fondo de Reserva 24/09/18:	2.355.296,72	2.868.750,00	5.224.046,72

(1) Avance técnico solicitado:	-2.667,75	-2.114,64	-4.782,39
Trimestre anterior	4.210,72	7.486,33	11.697,05
Trimestre actual	1.542,97	5.371,69	6.914,66
Importe préstamos fallidos del período:	83.078,39	0,00	83.078,39
Principal vencido y no cobrado superior a 1 mes e inferior a 12 meses:	-2.566,18	476,18	-2.090,00
Trimestre anterior	9.526,08	8.626,01	18.152,09
Trimestre actual	6.959,90	9.102,19	16.062,09

Destinatarios: CNMV, AIAF



Nº: 3789/18

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

http://www.tda-sgft.com

TDA15liq.trim|Sep18

TDA15-Mixto, FTA

Fondo de Titulización de Activos

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 24 de Septiembre de 2018

		Importes en euros	
I. BONOS A1 ES0377979002	Sobre 2289 bonos	Por Bono	
1. Saldo inicial (7/11/02):	228.900.000,00 €	100.000,00 €	
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	9.747.157,14 €	4.258,26 €	
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	882.775,74 €	385,66 €	
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	8.864.381,40 €	3.872,60 €	
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	3,872600%	3,872600%	
II. BONOS B1 ES0377979010	Sobre 95 bonos	Por Bono	
1. Saldo inicial (7/11/02):	9.500.000,00 €	100.000,00 €	
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	9.500.000,00 €	100.000,00 €	
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	8.111,10 €	85,38 €	
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	9.500.000,00 €	100.000,00 €	
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%	
III. BONOS A2 ES0377979028	Sobre 2008 bonos	Por Bono	
1. Saldo inicial (7/11/02):	200.800.000,00 €	100.000,00 €	
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	12.711.824,72 €	6.330,59 €	
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	999.843,44 €	497,93 €	
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	11.711.981,28 €	5.832,66 €	
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	5,832660%	5,832660%	
IV. BONOS B2 ES0377979036	Sobre 117 bonos	Por Bono	
1. Saldo inicial (7/11/02):	11.700.000,00 €	100.000,00 €	
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	11.700.000,00 €	100.000,00 €	
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	9.989,46 €	85,38 €	
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	11.700.000,00 €	100.000,00 €	
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%	
V. EL FONDO	Importes en euros		
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/08/18:			
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:	18.303.467,51 €	23.386.893,91 €	
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:	740.132,83 €	464.263,19 €	
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:	18.311.866,05 €	23.400.587,35 €	
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:	955.949,69 €	641.351,66 €	
2. Amortización anticipada del periodo 31/05/18 a 31/08/18:	859.387,84 €	997.012,57 €	
a) Según calendario:	750.005,01 €	742.869,57 €	
b) Amortización anticipada hasta 31/07/18:	48.172,81 €	223.143,74 €	
c) Amortización anticipada del 31/07/18 a 31/08/18:	61.210,02 €	30.999,26 €	
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):			
a) Último año:	4,35%	4,59%	
b) Último semestre:	2,00%	5,26%	
c) Último trimestre:	2,26%	4,11%	
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:	0,67%	1,08%	
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:	0,00%	0,00%	
6. Porcentaje de fallidos (1):	4,96%	2,67%	
7. Nivel de Impago(2):	0,21%	0,00%	

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

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

**Nº: 3790/18**

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.
 Orense, 58
 28020 Madrid
 Tel.: 917020808
<http://www.tda-sgft.com>
 TDA15\Infoinver.trim\Sep18

TDA 15-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 22/06/18-24/09/18

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO	
Fecha de Constitución del Fondo	4 de noviembre de 2002
Fecha Emisión BTH	4 de noviembre de 2002
Fecha Final Amortización BTH (4,35% TAA Grupo 1 / 4,59% TAA Grupo 2)	24 de diciembre de 2018
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisor Participaciones Hipotecarias	Bco. Sabadell (Bco. Guipuzcoano), Liberbank (Caja Cantabria) Caja Ingenieros, BBVA (Caixa Terrassa).
Agente de Pagos	Société Générale, Sucursal en España
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Moody's Investors Service
Calificación	Bono A1: (M) Aa1 (sf) Bono B1: (M) Aa1 (sf) Bono A2: (M) Aa1 (sf) Bono B2: (M) Aa1 (sf)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO	
Nombre	Bonos de Titulización TDA 15-MIXTO
Serie A1:	
Código ISIN	ES0377979002
Nominal en circulación total (inicial)	228.900.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	8.864.381,40 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	3.872,60 Euros
Serie B1:	ES0377979010
Código ISIN	
Nominal en circulación total (inicial)	9.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	9.500.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)	
Nombre	Bonos de Titulización TDA 15-MIXTO
Serie A2:	
Código ISIN	ES0377979028
Nominal en circulación total (inicial)	200.800.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	11.711.981,28 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.00,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	5.832,66 Euros
Serie B2:	ES0377979036
Código ISIN	
Nominal en circulación total (inicial)	11.700.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	11.700.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA
* Liquidación del Período:22/06/18-24/09/18
* Flujos de Caja del Período:22/06/18-24/09/18
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 24 de Septiembre de 2018

TDA 15-MIXTO*Fondo de Titulización de Activos***FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/06/18 - 24/09/18**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip.		1.882.619,18
Amortización Participaciones Hip.	1.856.400,41	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		18.100,56
Intereses recibidos de las PHs	173.015,36	
Intereses Ptmo. Subordinado		5.071,15
Intereses Inversiones Temporales	-6.187,09	
Avance Técnico Neto		4.782,39
III. GASTOS		
Comisiones y Gastos:		7.856,91
Remuneración variable del Préstamo Participativo		124.307,67
IV. Intereses pagados por recursos cedidos		
Total Ingresos/Pagos	2.023.228,68	2.042.737,86
Saldo inicial 22/06/18	5.329.553,31	
A Inversiones Temporales		5.310.044,13
Total	7.352.781,99	7.352.781,99
Retenciones practicadas el 24/09/18	3.439,11	
A Inversiones Temporales		3.439,11

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 3796/18**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA15\fluj.trim\Sep18