

## TDA 12, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 26/04/01 - 26/07/01

Personas que asumen la responsabilidad de esta información y cargos que ocupan

Carmen Barrenechea  
(Subdirectora General)

Manuel González Escudero  
(Subdirector General)

### I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	26 junio 2000
Fecha Emisión BTH	26 junio 2000
Fecha Final Amortización BTH (teórica) (8% TAA)	26 julio 2013
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias	El Monte Caja Castilla La Mancha Caixa Terrassa Caja Cantabria Banco Guipuzcoano AIG Finanzas
Agente de Pagos	Instituto de Crédito Oficial
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Moody's Investors Service España S.A
Calificación	Bonos A1: Aaa (Moody's) Bonos A2: Aaa (Moody's) Bonos A3: Aaa (Moody's) Bonos B: A2 (Moody's)

### II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Nombre	Bonos de Titulización Hipotecaria TDA 12	
<b>Serie A1:</b>		
Código ISIN	ES0377976008	
Nominal en circulación total (inicial)	12.828.360.600 Ptas.	77.100.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	-	25.702.056,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	16.638.600 Ptas.	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	-	33.336,00 Euros
<b>Serie A2:</b>		
Código ISIN	ES0377976016	
Nominal en circulación total (inicial)	14.542.136.400 Ptas.	87.400.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	-	87.400.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	16.638.600 Ptas.	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	-	100.000,00 Euros

<b>Serie A3:</b>		
Código ISIN	ES0377976024	
Nominal en circulación total (inicial)	54.707.716.800 Ptas.	328.800.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	-	328.800.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	16.638.600 Ptas.	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	-	100.000,00 Euros
<b>Serie B:</b>		
Código ISIN	ES0377976032	
Nominal en circulación total (inicial)	3.427.551.600 Ptas.	20.600.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	-	20.600.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	16.638.600 Ptas.	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	-	100.000,00 Euros

### III. INFORMACION INCLUIDA

- \* Liquidación del Período: 26/04/01 – 26/07/01
- \* Flujos de Caja del Período: 26/04/01 – 26/07/01
- \* Información a los inversores. Fecha de Pago: 26 de Julio de 2001

TdA
N.º <u>999 / 01</u>

**TDA 12**

Fondo de Titulización Hipotecaria  
**FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO 26/04/01 - 26/07/01**

	Pesetas		Euros	
	Ingresos	Pagos	Ingresos	Pagos
<b>I. INVERSIONES/FINANCIACIONES</b>				
Amortización Bonos Titulización Hip.		2.137.974.578		12.849.486,0
Amortización Participaciones Hip.	2.249.498.346		13.519.757,34	
Amortización Préstamos Subordinados		157.391.641		945.942,8
Disposición Línea Liquidez	157.856.140		948.734,51	
Amortización Línea Liquidez		91.006.195		546.952,2
<b>II. INTERESES</b>				
Intereses pagados a los BTH		1.001.715.925		6.020.433,5
Intereses recibidos de las PHs	1.157.569.626		6.957.133,57	
Intereses Préstamos Subordinados		60.650.270		364.515,4
Intereses Inversiones Temporales	54.613.173		328.231,78	
Intereses Línea Liquidez		332.250		1.996,8
Avance Técnico Neto	41.653.201		250.340,78	
<b>III. GASTOS</b>				
Comisión Gestora		12.534.095		75.331,4
Remuneración Variable del Préstamo Participativo		946.656		5.689,1
<b>Total Ingresos/Pagos</b>	<b>3.661.190.486</b>	<b>3.462.550.610</b>	<b>22.004.197,98</b>	<b>20.810.348,2</b>
<b>Saldo inicial 26/04/01</b>	<b>3.553.118.061</b>		<b>21.354.669,63</b>	
A Inversiones Temporales		2.479.500.145		14.902.096,1
Depósito de Principal		1.261.151.412		7.579.672,1
Depósito de Impagados		11.106.380		66.750,1
<b>Total</b>	<b>7.214.308.547</b>	<b>7.214.308.547</b>	<b>43.358.867,61</b>	<b>43.358.867,1</b>
<b>Retenciones practicadas el 26/07/01</b>	<b>180.307.369</b>		<b>1.083.669,11</b>	
A Inv. Temporales hasta 20/09/01 o devolución		180.307.369		1.083.669,1

Destinatarios: CNMV; AIAF.

TDA

Titulización de Activos, (SGFT), S.L.  
 Almagro, 26  
 28010 Madrid  
 Tel.: 917020808  
<http://www.tda-sgft.com>  
 TDA12Flujos.trimJulio01

Tda

N.º 1000/01

**TDA 12 - Fondo de Titulización Hipotecaria**  
**LIQUIDACIÓN DEL PERIODO 26/04/01 - 26/7/01**

	Euros							Total
	AIG	Cantabria	CCM	Gulpuzcoano	El Monte	Terrassa		
<b>L Situación al 26/04/01:</b>	<b>2.265.687,59</b>	<b>2.862.522,25</b>	<b>2.689.589,21</b>	<b>2.638.587,07</b>	<b>7.441.668,79</b>	<b>3.556.614,72</b>	<b>21.354.669,1</b>	
Saldo Inicial Cta. Reversión (FR)	894.126,40	1.832.957,71	2.662.377,14	1.824.328,38	5.379.656,38	2.488.649,91	14.902.096,1	
Depósito de Principal	1.369.539,16	1.020.153,38	0,00	900.271,64	2.048.867,37	1.082.183,65	8.401.015,1	
Depósito de Impagados	2.021,95	9.411,16	7.212,07	13.887,05	13.146,04	5.781,16	51.558,1	
<b>II. Fondos recibidos del emisor (II.1 - II.2 + II.3 - II.4 + II.5)</b>	<b>876.422,40</b>	<b>2.406.519,85</b>	<b>2.554.888,12</b>	<b>2.585.156,19</b>	<b>7.699.040,53</b>	<b>4.057.258,50</b>	<b>20.178.282,1</b>	
<b>II.1 Principal:</b>								
Según calendario hasta 30/06/01:	272.970,02	627.370,17	847.542,08	566.318,87	2.047.637,51	673.416,89	5.035.256,1	
Amort. Anticipada hasta 31/05/01:	93.881,56	504.684,91	505.968,36	590.922,88	1.548.658,06	1.379.728,94	4.623.745,1	
Amort. Anticipada último mes:	168.110,03	455.141,13	461.597,94	632.618,00	1.330.244,64	793.048,45	3.680.755,1	
II.2 Amortización Línea Liquidez	0,00	0,00	-546.952,24	0,00	0,00	0,00	-546.952,1	
II.3 Intereses:	340.365,85	803.225,87	1.226.052,40	760.808,13	2.614.806,36	1.212.074,88	8.957.133,1	
II.4 Intereses Línea Liquidez	0,00	0,00	-1.896,86	0,00	0,00	0,00	-1.896,1	
II.5 Avance técnico neto (1):	1.094,94	15.117,77	42.658,36	34.486,21	157.993,86	-1.008,46	250.340,1	
Principal:	770,53	5.828,61	17.385,23	14.082,83	69.445,27	-888,64	106.603,1	
Intereses:	324,41	9.289,16	25.271,13	20.403,38	88.548,69	-119,82	143.736,1	
<b>III. Subtotal = Cuenta de reversión (I + II):</b>	<b>3.142.109,99</b>	<b>5.268.042,10</b>	<b>6.244.477,33</b>	<b>5.123.742,26</b>	<b>18.140.709,32</b>	<b>7.613.871,22</b>	<b>41.532.882,1</b>	
<b>IV. Intereses de las Cuentas de reversión:</b>	<b>29.842,42</b>	<b>43.137,78</b>	<b>39.657,61</b>	<b>39.767,40</b>	<b>118.093,89</b>	<b>57.732,68</b>	<b>328.231,1</b>	
<b>V. Disposición Línea Liquidez:</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>948.734,81</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>948.734,1</b>	
<b>VI. Recursos disponibles (III + IV + V):</b>	<b>3.171.952,41</b>	<b>5.311.179,88</b>	<b>6.232.869,45</b>	<b>5.163.509,66</b>	<b>18.258.803,21</b>	<b>7.671.603,90</b>	<b>42.809.918,1</b>	
<b>VII. Gestor:</b>	<b>5.911,73</b>	<b>9.763,87</b>	<b>13.429,56</b>	<b>9.774,48</b>	<b>24.179,01</b>	<b>12.282,78</b>	<b>76.331,1</b>	
<b>VIII. Pago a los Bonos:</b>	<b>993.163,57</b>	<b>2.207.008,28</b>	<b>3.310.512,42</b>	<b>2.207.008,04</b>	<b>7.062.426,11</b>	<b>3.089.811,54</b>	<b>18.889.919,1</b>	
<b>Bonos A1:</b>								
Intereses correspondientes al 26/7/01:	24.480,46	54.401,04	81.601,56	54.401,04	174.083,32	76.161,46	465.128,1	
Retenciones practicadas a los bonos:	-4.406,47	-9.782,15	-14.688,23	-8.782,15	-31.334,88	-13.705,01	-88.722,1	
Amortización correspondiente al 26/7/01:	678.288,57	1.502.863,92	2.254.295,89	1.892.853,76	4.809.164,30	2.104.009,46	12.848.486,1	
<b>Bonos A2:</b>								
Intereses correspondientes al 26/7/01:	56.894,53	128.432,54	189.648,81	128.432,53	404.584,10	177.005,55	1.080.998,1	
Retenciones practicadas a los bonos:	-10.240,98	-22.767,73	-34.136,60	-22.767,73	-72.824,75	-31.860,83	-194.578,1	
Amortización correspondiente al 26/7/01:	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,1	
<b>Bonos A3:</b>								
Intereses correspondientes al 26/7/01:	221.038,37	481.198,46	736.794,68	491.186,40	1.571.828,88	687.875,03	4.188.729,1	
Retenciones practicadas a los bonos:	-39.786,53	-88.414,52	-132.621,77	-88.414,51	-282.928,44	-123.780,32	-755.944,1	
Amortización correspondiente al 26/7/01:	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,1	
<b>Bonos B:</b>								
Intereses correspondientes al 26/7/01:	14.461,44	32.114,32	48.171,48	32.114,31	102.765,81	44.960,04	274.577,1	
Retenciones practicadas a los bonos:	-2.601,24	-5.780,53	-8.870,79	-5.760,53	-18.497,89	-8.092,74	-49.423,1	
Amortización correspondiente al 26/7/01:	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,1	
Reversión o devolución de las retenciones (2):	57.035,22	126.744,93	190.117,39	126.744,92	405.583,76	177.442,90	1.083.669,1	
<b>IX. Principal depositado para próxima amortización de bonos</b>	<b>1.228.982,62</b>	<b>1.110.294,28</b>	<b>0,00</b>	<b>1.201.331,56</b>	<b>2.235.568,55</b>	<b>1.803.476,63</b>	<b>7.579.672,1</b>	
<b>X. Saldo disponible (VI - VII - VIII - IX):</b>	<b>943.904,49</b>	<b>1.984.123,45</b>	<b>2.908.927,47</b>	<b>1.745.395,58</b>	<b>5.936.609,54</b>	<b>2.766.033,95</b>	<b>16.284.994,1</b>	
<b>Distribución del saldo disponible:</b>								
Fondo Reserva 26/7/01	894.126,48	1.832.957,71	2.682.377,14	1.624.328,38	5.379.656,38	2.488.649,91	14.902.096,1	
Aportación al FR	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,1	
Depósito de impagados requerido en esta fecha de pago (3)	2.448,88	8.712,68	8.072,10	23.697,38	15.762,84	6.058,83	68.750,1	
Intereses pagados Préstamo Subordinado A	1.806,38	4.055,77	4.890,36	3.859,09	6.042,56	5.919,81	26.673,1	
Intereses debidos Préstamo Subordinado A	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,1	
Amortización Préstamo Subordinado A	31.965,60	74.114,20	172.813,82	3.667,73	432.818,50	215.885,95	931.287,1	
Intereses pagados Préstamo Subordinado B	489,14	1.278,80	1.630,47	1.278,80	3.478,35	1.790,33	9.948,1	
Intereses debidos Préstamo Subordinado B	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,1	
Amortización Préstamo Subordinado B	0,00	0,00	0,00	0,00	14.655,81	0,00	14.655,1	
Remuneración fija pagada Préstamo Participativo	13.047,86	63.004,29	39.143,56	88.464,20	78.504,58	45.731,12	327.895,1	
Remuneración fija debida Préstamo Participativo	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,1	
Amortización Préstamo Participativo	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,1	
Pago de remuneración variable Préstamo Participativo	0,00	0,00	0,00	0,00	5.689,52	0,00	5.689,1	

(1) Avance técnico solicitado

Trimestre anterior

Trimestre actual

(2) Reversión hasta el 20/9/01

(3) Principal vencido y no pagado superior a 1 mes e inferior a 12 meses

T  
 S. de Titulización Hipotecaria, S.A.  
 Calle de Alcalá, 24  
 28014 Madrid  
 Tel: 91 400 00 00  
 Fax: 91 400 00 01

**TdA**  
 N.º 924/01 (Euros)

**TDA 12 - Fondo de Titulización Hipotecaria**  
LIQUIDACION DEL PERIODO 26/04/01 - 26/7/01

	Pesetas							Total
	AIG	Cantabria	CCM	Gulpugetano	El Monte	Terrassa		
<b>I. Situación al 26/04/01:</b>	<b>376.978.695</b>	<b>476.283.627</b>	<b>447.509.990</b>	<b>422.385.348</b>	<b>1.238.189.504</b>	<b>591.770.897</b>	<b>3.553.118.1</b>	
Saldo Inicial Cta. Reversión (FR)	148.770.129	304.978.502	446.310.003	270.265.502	695.099.506	414.076.504	2.479.500.	
Depósito de Principal	227.872.143	169.739.240	0	149.792.597	340.802.846	178.732.489	1.065.039.	
Depósito de Impagados	336.424	1.565.888	1.199.987	2.327.249	2.187.151	961.904	8.578.	
<b>II. Fondos recibidos del emisor (II.1 - II.2 + II.3 - II.4 + II.5 )</b>	<b>145.824.417</b>	<b>400.244.826</b>	<b>425.097.615</b>	<b>430.135.631</b>	<b>1.281.012.558</b>	<b>675.070.680</b>	<b>3.357.383.1</b>	
<b>II.1 Principal:</b>								
Según calendario hasta 30/06/01:	45.418.390	104.385.613	141.019.137	94.227.716	340.898.215	112.047.109	837.796.	
Amort. Anticipada hasta 31/05/01:	15.620.577	83.069.176	84.189.379	98.321.294	257.658.381	229.567.746	769.326.	
Amort. Anticipada último mes:	27.971.155	78.729.112	80.131.155	106.258.779	221.334.085	131.951.327	642.375.1	
<b>II.2 Amortización Línea Liquidez</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>-91.005.195</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>-91.005.</b>	
<b>II.3 Intereses:</b>	<b>58.632.112</b>	<b>133.645.540</b>	<b>203.897.969</b>	<b>126.987.822</b>	<b>438.033.884</b>	<b>201.672.291</b>	<b>1.157.569.1</b>	
<b>II.4 Intereses Línea Liquidez</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>-332.250</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>-332.</b>	
<b>II.5 Avance técnico neto (1):</b>	<b>162.183</b>	<b>2.519.385</b>	<b>7.097.421</b>	<b>5.738.023</b>	<b>26.287.863</b>	<b>-187.794</b>	<b>41.653.</b>	
Principal:	128.205	969.798	2.892.659	2.339.858	11.564.721	-147.857	17.797.	
Intereses:	53.977	1.548.586	4.204.762	3.398.165	14.723.142	-19.036	23.918.1	
<b>III. Subtotal a Cuenta de re inversión (I + II):</b>	<b>522.803.113</b>	<b>876.528.453</b>	<b>872.807.605</b>	<b>852.518.880</b>	<b>2.519.202.081</b>	<b>1.266.841.577</b>	<b>6.910.501.7</b>	
<b>IV. Intereses de las Cuentas de re inversión:</b>	<b>4.965.361</b>	<b>7.177.523</b>	<b>6.598.471</b>	<b>6.618.738</b>	<b>19.649.170</b>	<b>9.605.910</b>	<b>54.513.1</b>	
<b>V. Disposición Línea Liquidez</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>157.856.140</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>157.856.1</b>	
<b>VI. Recursos disponibles (III + IV + V):</b>	<b>527.768.474</b>	<b>883.705.976</b>	<b>1.037.062.216</b>	<b>859.136.718</b>	<b>2.538.851.231</b>	<b>1.276.447.487</b>	<b>7.122.971.1</b>	
<b>VII. Gastos:</b>	<b>983.629</b>	<b>1.622.907</b>	<b>2.234.491</b>	<b>1.626.337</b>	<b>4.023.049</b>	<b>2.043.883</b>	<b>12.534.0</b>	
<b>VIII. Pago a los Bonos:</b>	<b>165.246.850</b>	<b>367.215.280</b>	<b>550.822.920</b>	<b>367.215.240</b>	<b>1.175.088.831</b>	<b>514.101.383</b>	<b>3.138.690.5</b>	
<b>Bonos A1:</b>								
Intereses correspondientes al 26/7/01:	4.073.206	9.051.571	13.577.357	9.051.571	26.865.027	12.672.201	77.390.5	
Retenciones practicadas a los bonos:	-733.175	-1.629.277	-2.443.916	-1.629.277	-5.213.885	-2.280.987	-13.830.3	
Amortización correspondiente al 26/7/01:	112.524.987	250.055.518	375.083.276	280.055.490	600.177.611	350.077.718	2.137.874.5	
<b>Bonos A2:</b>								
Intereses correspondientes al 26/7/01:	9.468.470	21.036.606	31.554.907	21.036.603	67.317.130	29.451.245	179.862.8	
Retenciones practicadas a los bonos:	-1.703.856	-3.788.568	-5.679.852	-3.786.568	-12.117.019	-5.301.186	-32.375.1	
Amortización correspondiente al 26/7/01:	0	0	0	0	0	0	0	
<b>Bonos A3:</b>								
Intereses correspondientes al 26/7/01:	38.777.690	81.728.214	122.592.320	81.728.204	261.530.270	114.419.498	698.778.1	
Retenciones practicadas a los bonos:	-8.619.922	-14.710.938	-22.066.408	-14.710.937	-47.074.999	-20.593.312	-125.778.5	
Amortización correspondiente al 26/7/01:	0	0	0	0	0	0	0	
<b>Bonos B:</b>								
Intereses correspondientes al 26/7/01:	2.404.517	5.343.373	8.016.080	5.343.372	17.098.792	7.480.721	46.885.8	
Retenciones practicadas a los bonos:	-432.810	-961.799	-1.442.688	-961.799	-3.077.757	-1.346.519	-8.223.3	
Amortización correspondiente al 26/7/01:	0	0	0	0	0	0	0	
Reversión o devolución de las retenciones (2):	9.489.862	21.088.582	31.632.872	21.088.580	67.483.459	29.624.014	180.307.9	
<b>IX. Principal depositado para próxima amortización de bonos:</b>	<b>204.485.502</b>	<b>184.737.424</b>	<b>0</b>	<b>199.884.753</b>	<b>371.970.636</b>	<b>300.073.096</b>	<b>1.261.151.4</b>	
<b>X. Saldo disponible (VI - VII - VIII - IX):</b>	<b>157.052.482</b>	<b>330.130.364</b>	<b>484.004.806</b>	<b>290.409.389</b>	<b>987.768.715</b>	<b>460.229.325</b>	<b>2.709.595.0</b>	
<b>Distribución del saldo disponible:</b>								
Fondo Reserva 26/7/01	148.770.129	304.978.502	446.310.003	270.265.502	695.099.506	414.076.504	2.479.500.1	
Aportación al FR	0	0	0	0	0	0	0	
Depósito de impagados requerido en esta fecha de pago (3)	407.456	1.448.868	1.343.084	3.942.912	2.622.716	1.340.544	11.106.3	
Intereses pagados Préstamo Subordinado A	300.551	674.823	813.691	658.737	1.005.397	984.974	4.438.1	
Intereses debidos Préstamo Subordinado A	0	0	0	0	0	0	0	
Amortización Préstamo Subordinado A	6.321.989	12.331.865	28.753.800	610.269	72.016.105	35.920.400	154.953.1	
Intereses pagados Préstamo Subordinado B	81.386	212.774	271.287	212.774	578.749	297.886	1.654.8	
Intereses debidos Préstamo Subordinado B	0	0	0	0	0	0	0	
Amortización Préstamo Subordinado B	0	0	0	0	2.438.522	0	2.438.5	
Remuneración fija pagada Préstamo Participativo	2.170.981	10.489.032	6.512.940	14.719.204	13.062.063	7.609.018	54.557.2	
Remuneración fija debida Préstamo Participativo	0	0	0	0	0	0	0	
Amortización Préstamo Participativo	0	0	0	0	0	0	0	
Pago de remuneración variable Préstamo Participativo	0	0	0	0	946.656	0	946.6	

(1) Avance técnico solicitado:

Trimestre anterior

208.007

1.350.691

3.372.640

20.732.1

Trimestre actual

288.951


10.371.719

3.204.848

71.405.1

(2) Revertido hasta el 20/9/01

(3) Principal vencido y no pagado superior a 1 mes e inferior a 12 meses

  
 Tituladora de Activos, S.A.  
 Avda. de Europa, 28  
 28014 Madrid  
 Tel: 91 540 00 00  
 Fax: 91 540 00 00  
 www.tda.es  
 TDA 12 (1) - 2001

**TdA**  
 N.º 924/01 (Plus)

## TDA 12

Fondo de Titulización Hipotecaria  
**INFORMACION A LOS INVERSORES**  
 FECHA DE PAGO: 26 de Julio de 2001

I. BONOS A1	Importes en pesetas		Importes en euros	
	Sobre 771 bonos	Por Bono	Sobre 771 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (5/07/00):	12.828.360.600 Pts	16.638.600 Pts	77.100.000,00 €	100.000,00
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	-	-	38.551.542,00 €	50.002,00
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	77.390.934 Pts	100.377 Pts	465.128,88 €	603,28
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	2.137.974.578 Pts	2.772.969 Pts	12.849.486,00 €	16.666,00
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	-	-	25.702.056,00 €	33.336,00
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	-	-	33,34%	33,34%
II. BONOS A2	Sobre 874 bonos	Por Bono	Sobre 874 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (5/07/00):	14.542.136.400 Pts	16.638.600 Pts	87.400.000,00 €	100.000,00
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	-	-	87.400.000,00 €	100.000,00
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	179.862.960 Pts	205.793 Pts	1.080.998,16 €	1.236,84
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0 Pts	0 Pts	0,00 €	0,00
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	-	-	87.400.000,00 €	100.000,00
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	-	-	100,00%	100,00%
III. BONOS A3	Sobre 3288 bonos	Por Bono	Sobre 3288 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (5/07/00):	54.707.716.800 Pts	16.638.600 Pts	328.800.000,00 €	100.000,00
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	-	-	328.800.000,00 €	100.000,00
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	698.776.196 Pts	212.523 Pts	4.199.729,52 €	1.277,29
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0 Pts	0 Pts	0,00 €	0,00
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	-	-	328.800.000,00 €	100.000,00
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	-	-	100,00%	100,00%
IV. BONOS B	Sobre 206 bonos	Por Bono	Sobre 206 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (5/07/00):	3.427.551.600 Pts	16.638.600 Pts	20.600.000,00 €	100.000,00
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	-	-	20.600.000,00 €	100.000,00
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	45.685.835 Pts	221.776 Pts	274.577,40 €	1.332,90
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0 Pts	0 Pts	0,00 €	0,00
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	-	-	20.600.000,00 €	100.000,00
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	-	-	100,00%	100,00%
V. EL FONDÓ	Importes en pesetas		Importes en euros	
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 30/06/01:		75.839.465.436		455.804.367,17
a) No Fallidas:		75.839.465.436		455.804.367,17
b) Fallidas:		0		0,00
2. Amortización del período 31/3/01 a 30/06/01:		2.249.498.344		13.519.757,33
a) Según calendario:		837.796.177		5.035.256,43
b) Amortización anticipada hasta 31/05/01:		769.326.554		4.623.745,71
c) Amortización anticipada del 31/05/01 al 30/06/01:		642.375.613		3.860.755,19
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):				
a) Desde la Fecha de Desembolso:		7,57%		7,57%
b) Último año:		-		-
c) Último semestre:		8,13%		8,13%
d) Último trimestre:		7,11%		7,11%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:		0,66%		0,66%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:		0,06%		0,06%
6. Porcentaje de fallidas (1):		0,00%		0,00%

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

TdA

N.º 925/01 (España)

Titulación de Activos (SGFI), S.A.  
 Almagro, 26  
 28010 Madrid  
 Tel.: 917020800  
 http://www.tda-sgfi.com