

TDA 21 - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO: 16/02/11 - 16/08/11

	EUROS		
	BARCLAYS BZ05	BARCLAYS BZ06	TOTAL
I. Situación al 16/02/11:	7.782.519,46	10.345.411,23	18.127.930,69
Saldo inicial Ctas. Tesorería	7.782.519,46	10.345.411,23	18.127.930,69
II. Fondos recibidos del emisor	161.054.951,01	38.414.643,18	199.469.594,19
Principal:	11.012.482,32	3.814.508,43	14.826.990,75
(a) Según calendario hasta 26/07/11:	5.689.252,16	2.724.504,65	8.413.756,81
(b) Amort. Anticipada hasta 26/07/11:	5.233.782,26	989.273,24	6.223.055,50
(c) Recuperación Fallidos hasta 26/07/11:	89.447,90	100.730,54	190.178,44
Intereses:	2.048.669,99	546.029,56	2.594.699,55
(a) Según calendario hasta 26/07/11:	1.577.118,67	339.943,69	1.917.062,36
(b) Recuperación Interes 26/07/11:	430.280,87	167.393,82	597.674,69
(c) Intereses Demora 26/07/11:	10.724,49	17.360,27	28.084,76
(d) Recuperación Interes Fallidos hasta 26/07/11:	30.545,96	21.331,78	51.877,74
Ingreso Liquidación Anticipada	147.993.798,70	34.054.105,19	182.047.903,89
III. Subtotal a Cuentas Tesorería (reversión) (I + II):	168.837.470,47	48.760.054,41	217.597.524,88
IV. Intereses de Reversión:	164.588,70	81.776,91	246.365,61
V. Recursos disponibles (III + IV):	169.002.059,17	48.841.831,32	217.843.890,49
VI. Gastos Varios	140.037,33	32.171,13	172.208,46
VII. Liquidación SWAP:	-187.411,89	-42.385,60	-229.797,49
Cantidad a Pagar por la Parte A	955.808,51	222.383,31	1.178.191,82
Cantidad a Pagar por la Parte B	768.396,62	179.997,71	948.394,33
VIII. Pago a los Bonos:	157.770.748,31	37.885.924,00	195.656.672,31
Bonos A1:			
Intereses correspondientes al 16/08/11:	1.126.979,04	0,00	1.126.979,04
Retenciones practicadas a los bonos:	214.109,72	0,00	214.109,72
Amortización correspondiente al 16/08/11:	147.082.020,25	0,00	147.082.020,25
Bonos B1:			
Intereses correspondientes al 16/08/11:	86.890,08	0,00	86.890,08
Retenciones practicadas a los bonos:	16.508,55	0,00	16.508,55
Amortización correspondiente al 16/08/11:	9.474.858,94	0,00	9.474.858,94
Bonos B2:			
Intereses correspondientes al 16/08/11:	0,00	433.846,00	433.846,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00	82.431,50	82.431,50
Amortización correspondiente al 16/08/11:	0,00	37.452.078,00	37.452.078,00
Reversión de las retenciones -Cta (1):	-230.618,27	-82.431,50	-313.049,77
IX. Saldo disponible (V- VI + VII - VIII):	10.903.861,64	10.881.350,59	21.785.212,23
Distribución del saldo disponible:			
Fondo de Reserva previo 16/02/11:	7.782.519,46	10.345.411,23	18.127.930,69
Aportación al Fondo de Reserva	-7.782.519,46	-10.345.411,23	-18.127.930,69
Fondo de Reserva 16/08/11:	0,00	0,00	0,00
Intereses pagados Préstamo Sub. para Constitución Fondo de Reserva	72.544,76	119.841,24	192.386,00
Intereses de Demora Pagados Préstamo Sub. para Constitución Fondo de Reserva	0,00	0,00	0,00
Amortización Préstamo Sub. para Constitución Fondo de Reserva	7.782.519,46	10.345.411,23	18.127.930,69
Comisión de Admón.	7.850,80	1.881,67	9.732,47
Margen de Intermediación Financiera	3.040.946,62	414.216,45	3.455.163,07
Comisión Administración del periodo	7.850,80	1.881,67	9.732,47
Comisión Administración Debida	0,00	0,00	0,00

(1) Reinvertido hasta el 20/09/11

Destinatarios: CNMV, AIAF



Nº: 6171/11

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.: 917020808

http://www.tda-sgft.com

TDA21liq.sem.Ago11

TDA 21

INFORMACION A LOS INVERSORES
FECHA DE PAGO: 16 de agosto de 2011

		Importes en euros	
I. BONOS A1 ES0377982006	Sobre 5093 bonos	Por Bono	
1. Saldo inicial (29/07/04):	509.300.000,00 €	100.000,00 €	
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	147.082.020,25 €	28.879,25 €	
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	1.126.979,04 €	221,28 €	
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	147.082.020,25 €	28.879,25 €	
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	0,000000%	0,000000%	
II. BONOS B1 ES0377982014	Sobre 157 bonos	Por Bono	
1. Saldo inicial (29/07/04):	15.700.000,00 €	100.000,00 €	
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	9.474.858,94 €	60.349,42 €	
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	86.890,08 €	553,44 €	
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	9.474.858,94 €	60.349,42 €	
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	0,000000%	0,000000%	
III. BONOS B2 ES0377982030	Sobre 475 bonos	Por Bono	
1. Saldo inicial (29/07/04):	47.500.000,00 €	100.000,00 €	
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	37.452.078,00 €	78.846,48 €	
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	433.846,00 €	913,36 €	
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	37.452.078,00 €	78.846,48 €	
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	0,000000%	0,000000%	
IV. EL FONDO	Importes en euros		
	GRUPO1	GRUPO2	
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 26/07/11:	147.304.738,45 €	34.130.773,08 €	
a) No Fallidas:	145.633.852,36 €	33.738.299,47 €	
b) Fallidas:	1.670.886,09 €	392.473,61 €	
2. Amortización del periodo desde 08/02/11 a 26/07/11:	11.012.482,32 €	3.814.508,43 €	
a) Según calendario:	5.778.700,06 €	2.825.235,19 €	
b) Amortización anticipada hasta 26/07/11:	5.233.782,26 €	989.273,24 €	
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):			
b) Ultimo año:	6,27%	4,43%	
c) Ultimo semestre:	6,82%	5,62%	
d) Ultimo trimestre:	3,07%	5,50%	
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:	0,49%	3,20%	
5. Porcentaje de impago entre 7 y 17 meses:	0,44%	2,43%	
6. Porcentaje de fallidos (1):	1,15%	1,16%	
7. Nivel de impago(2):	0,93%	3,23%	

(1) Según definición Folleto, capitales vencidos y pendientes de vencimiento correspondientes a Préstamos Hipotecarios que hayan acumulado en el pago de principal o interes un retraso igual o superior a 18 meses.

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

Destinatarios: Emisores; Agente de Pagos; CNMV; AIAF



Nº: 6172/11

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA 21\Infoinver.sem\Ago11

TDA 21, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERIODO: 16/02/11-16/08/11

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	23 de julio de 2004
Fecha Emisión BTH	23 de julio de 2004
Fecha Final Amortización BTH (teórica) (10% TAA)	16 de agosto de 2011
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias	Barclays Bank, S.A.
Agente de Pagos	Barclays Bank, S.A.
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Standard & Poor´s
Calificación	Bonos A1: AAA (sf) (S&P) Bonos B1: A (sf) (S&P) Bonos B2: BBB (sf) (S&P)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Nombre	Bonos de Titulización TDA 21
Serie A1:	
Código ISIN	ES0377982006
Nominal en circulación total (inicial)	509.300.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	0,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	0,00 Euros
Serie B1:	
Código ISIN	ES0377982014
Nominal en circulación total (inicial)	15.700.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	0,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	0,00 Euros

TDA21\INFO.trim\Ago11



II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)

Nombre	Bonos de Titulización TDA 21
Serie B2:	
Código ISIN	ES0377982030
Nominal en circulación total (inicial)	47.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	0,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	0,00 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA

* Liquidación del Período:16/02/11-16/08/11
* Flujos de Caja del Período:16/02/11-16/08/11
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 16 de Agosto de 2011

TDA21\INFO.trim\Ago11

TDA 21

Fondo de Titulización de Activos
FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 16/02/11 - 16/08/11

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip.		194.008.957,19
Amortización Participaciones Hip.	14.826.990,75	
Amortización Ptmos. Subordinados		18.127.930,69
Recompra	182.047.903,89	
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		1.647.715,12
Intereses recibidos de las PHs	2.594.699,55	
Intereses Ptmo. Subordinado		192.386,00
Intereses Inversiones Temporales	246.365,61	
III. GASTOS		
Comisiones Periódicas:		181.940,93
Neto SWAP		229.797,49
Margen de Intermediación Financiera		3.455.163,07
Total Ingresos/Pagos	<u>199.715.959,80</u>	<u>217.843.890,49</u>
Saldo inicial 16/02/11	18.127.930,69	
A Inversiones Temporales		0,00
Total	<u>217.843.890,49</u>	<u>217.843.890,49</u>
Retenciones practicadas el 16/08/11:		
A Inv.Temporales hasta el 20/09/11	-313.049,77	-313.049,77

Destinatarios: CNMV; AIAF.



TdA
Titulización
de Activos

Nº: 6177/11

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA21\fluj.sem\Ago11