

TDA 19-MIXTO - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 22/03/18 - 22/06/18

| | Euros |
|---|----------------------|
| | Total |
| I. Situación al 22/03/18: | 11.693.038,20 |
| Saldo inicial Fondo de Reserva | 11.693.038,20 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 4.098.701,76 |
| Principal: | |
| Según calendario 31/05/18: | 2.601.044,50 |
| Amort. Anticipada hasta 31/05/18: | 1.050.751,54 |
| Intereses: | 446.905,72 |
| III. Subtotal Cuenta de reinversión (I + II): | 15.791.739,96 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | -14.512,35 |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | -13.189,33 |
| Intereses de la Cta. De Cobros | -1.323,02 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 15.777.227,61 |
| VI. Gastos: | 22.597,14 |
| VII. Liquidación SWAP: | -274.761,08 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (JP Morgan): | -48.111,96 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo): | 226.649,12 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 3.750.769,68 |
| Bonos A: | |
| Intereses correspondientes al 22/06/18: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 22/06/18: | 3.348.658,44 |
| Bonos B: | |
| Intereses correspondientes al 22/06/18: | 2.396,16 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -455,27 |
| Amortización correspondiente al 22/06/18: | 255.454,08 |
| Bonos C: | |
| Intereses correspondientes al 22/06/18: | 3.352,80 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -637,03 |
| Amortización correspondiente al 22/06/18: | 84.784,20 |
| Bonos D: | |
| Intereses correspondientes al 22/06/18: | 56.124,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -10.663,56 |
| Amortización correspondiente al 22/06/18: | 0,00 |
| Reinversión o devolución de las retenciones: | 11.755,86 |
| IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII): | 11.729.099,71 |
| Distribución del saldo disponible: | |
| Fondo de Reserva (22/03/18) | 11.693.038,20 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 0,00 |
| Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada | 20.050,96 |
| Amortización Préstamo Participativo | 0,00 |
| Remuneración Variable Prést. Participativo | 16.010,55 |
| Fondo de Reserva (22/06/18) | 11.693.038,20 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº:2542/18

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA19\liq.trim\Jun18

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 22 de Junio de 2018

Importes en euros

| I. BONOS A ES0377964004 | | Sobre 5673 bonos | Por Bono |
|---|------------------|-------------------|-----------------|
| 1. Saldo inicial (03/03/04): | 567.300.000,00 € | | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 71.865.790,92 € | | 12.668,04 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 3.348.658,44 € | | 590,28 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 68.517.132,48 € | | 12.077,76 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 12,077760% | | 12,077760% |
| II. BONOS B ES0377964012 | | Sobre 192 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (03/03/04): | 19.200.000,00 € | | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 5.482.300,80 € | | 28.553,65 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 2.396,16 € | | 12,48 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 255.454,08 € | | 1.330,49 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 5.226.846,72 € | | 27.223,16 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 27,223160% | | 27,223160% |
| III. BONOS C ES0377964020 | | Sobre 60 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (03/03/04): | 6.000.000,00 € | | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 1.819.554,00 € | | 30.325,90 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 3.352,80 € | | 55,88 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 84.784,20 € | | 1.413,07 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 1.734.769,80 € | | 28.912,83 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 28,912830% | | 28,912830% |
| IV. BONOS D ES0377964038 | | Sobre 75 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (03/03/04): | 7.500.000,00 € | | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 6.925.789,50 € | | 92.343,86 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 56.124,00 € | | 748,32 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 6.925.789,50 € | | 92.343,86 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 92,343860% | | 92,343860% |
| V. EL FONDO | | Importes en euros | |
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/05/18: | | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas: | | | 82.404.534,48 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas: | | | 2.080.430,59 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas: | | | 82.470.592,84 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidas: | | | 2.383.824,39 € |
| 2. Amortización del período 28/02/18 a 31/05/18: | | | 3.651.796,04 € |
| a) Según calendario: | | | 2.601.044,50 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/05/18: | | | 1.050.751,54 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | | |
| a) Último año: | | | 3,49% |
| b) Último semestre: | | | 4,57% |
| c) Último trimestre: | | | 4,79% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | | | 0,52% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses: | | | 0,04% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | | | 2,81% |
| 7. Nivel de Impago (2): | | | 0,08% |

(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 impagadas durante el período de tiempo comprendido entre el segundo y el noveno mes inmediatamente anteriores a la correspondiente Fecha de Pago respecto al saldo nominal pendiente de las Participaciones Hipotecarias

Destinatarios: Emisor; CNMV; AIAF.



Nº: 2543/18

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.: 917020808
<http://www.tda-sgft.com>
TDA19Infinver.trimJun18

TDA 19-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 22/03/18 - 22/06/18

| I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO | |
|---|--|
| Fecha de Constitución del Fondo | 27 de febrero de 2004 |
| Fecha Emisión BTH | 27 de febrero de 2004 |
| Fecha Final Amortización Bonos (3,49% TAA) | 22 de junio de 2021 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca | Cajamar BBVA (C. Tarragona) |
| Agente de Pagos | BNP PARIBAS |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Moody's Investors Service/ Fitch Ibc |
| Calificación | Bono A: Aa1 (sf) (M) / AAA (sf) (F) Bono B: Aa1 (sf) (M) / AAA (sf) (F) Bono C: Aa1 (sf) (M) / AAA (sf) (F) Bono D: Baa2 (sf) (M) / A+ (sf) (F) |

| II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO | |
|---|------------------------------------|
| Nombre | Bonos de Titulización TDA 19-MIXTO |
| Serie A: | |
| Código ISIN | ES 0377964004 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 567.300.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 68.517.132,48 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.00,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 12.077,76 Euros |
| Serie B: | |
| Código ISIN | ES 0377964012 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 19.200.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 5.226.846,72 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 27.223,16 Euros |

| II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (Cont.) | |
|--|---|
| Nombre | Bonos de Titulización TDA 19-MIXTO |
| Serie C: | |
| Código ISIN | ES 0377964020 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 6.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 1.734.769,80 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 28.912,83 Euros |
| Serie D: | |
| Código ISIN | ES 0377964038 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 7.500.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 6.925.789,50 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 92.343,86 Euros |

| III. INFORMACION INCLUIDA |
|--|
| * Liquidación del Período: 22/03/18 - 22/06/18 |
| * Flujos de Caja del Período: 22/03/18 - 22/06/18 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Junio de 2018 |

TDA 19-MIXTO*Fondo de Titulización de Activos***FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/03/18 - 22/06/18**

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | Euros | |
|--|--------------------------|--------------------------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| Amortización Bonos Titulización Hip. Amortización Participaciones Hip. | 3.651.796,04 | 3.688.896,72 |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH Intereses recibidos de las PHs Intereses Ptmos. Subordinados Intereses Inversiones Temporales | 446.905,72 -14.512,35 | 61.872,96 20.050,96 |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: Neto swap a favor de JP Morgan Remuneración Variable Préstamo Participativo | | 22.597,14 274.761,08 16.010,55 |
| Total Ingresos/Pagos | 4.084.189,41 | 4.084.189,41 |
| Saldo inicial 22/03/18 A Inversiones Temporales | 11.693.038,20 | 11.693.038,20 |
| Total | 15.777.227,61 | 15.777.227,61 |
| Retenciones practicadas el 22/06/18 A Inv.Temporales | 11.755,86 | 11.755,86 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 2549/18**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA 19\fluj.trim\Jun18