

CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA - Fondo de Titulización de Activos
LIQUIDACION DEL PERIODO 28/03/14 - 30/06/14

| | Euros |
|---|----------------------|
| I. Situación al 28/03/14: | 5.956.620,07 |
| Situación Inicial Fondo | 5.956.620,07 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 11.724.777,51 |
| Principal: | |
| Según calendario hasta 31/05/14: | 4.574.566,18 |
| Amort. Anticipada hasta 31/05/14: | 6.117.017,36 |
| Intereses | 1.033.193,97 |
| III. Subtotal a Cuenta de reinversión (I + II): | 17.681.397,58 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | 3.807,72 |
| Intereses de Cuenta de Reinversión | 3.801,70 |
| Intereses de la Cuenta de Tesorería | 6,02 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 17.685.205,30 |
| VI. Gastos: | 28.236,65 |
| VII. Liquidación SWAP: | -116.461,53 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (Fondo): | 220.818,38 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (JP Morgan Chase): | 104.356,85 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 11.373.087,06 |
| Bonos A: | |
| Intereses correspondientes al 30/06/14: | 127.776,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -26.862,00 |
| Amortización correspondiente al 30/06/14: | 11.099.741,40 |
| Bonos B: | |
| Intereses correspondientes al 30/06/14: | 89.088,50 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -18.709,70 |
| Amortización correspondiente al 30/06/14: | 0,00 |
| Bonos C: | |
| Intereses correspondientes al 30/06/14: | 56.481,16 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -11.861,16 |
| Amortización correspondiente al 30/06/14: | 0,00 |
| Reinversión o devolución de las retenciones (1): | 57.432,86 |
| IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII): | 6.167.420,06 |
| Distribución del saldo disponible: | |
| Fondo de Reserva previo (28/03/14): | 5.956.620,07 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 210.799,99 |
| Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada | 0,00 |
| Amortización Préstamo Participativo | 0,00 |
| Remuneración Variable Prést. Participativo | 0,00 |
| Fondo de Reserva 30/06/14: | 6.167.420,06 |

Destinatarios: CNMV; AIAF


Nº: 3811/14

Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA Liq.trimJun14

CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 30 de Junio de 2014

Importes en euros

| I. BONOS A ES0357326000 | Sobre 7260 bonos | Por Bono |
|---|------------------|--------------|
| 1. Saldo inicial (28/06/07): | 726.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 96.925.210,80 € | 13.350,58 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 127.776,00 € | 17,60 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 11.099.741,40 € | 1.528,89 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 85.825.469,40 € | 11.821,69 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 11,821690% | 11,821690% |

| II. BONOS B ES0357326018 | Sobre 446 bonos | Por Bono |
|---|-----------------|--------------|
| 1. Saldo inicial (28/06/07): | 44.600.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 44.600.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 89.088,50 € | 199,75 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 44.600.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |

| III. BONOS C ES0357326026 | Sobre 194 bonos | Por Bono |
|---|-----------------|--------------|
| 1. Saldo inicial (28/06/07): | 19.400.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 19.400.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 56.481,16 € | 291,14 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 19.400.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |

| IV. EL FONDO | Importes en euros |
|--|-------------------|
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/05/14: | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas: | 149.825.443,69 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas: | 10.225.928,35 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas : | 150.741.380,39 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidas: | 11.807.851,72 € |
| 2. Amortización del período 28/02/14 a 31/05/14: | 10.691.583,54 € |
| a) Según calendario: | 4.574.566,18 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/05/14: | 6.117.017,36 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | |
| a) Ultimo año: | 6,19% |
| b) Ultimo semestre: | 9,35% |
| c) Ultimo trimestre: | 14,36% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | 3,08% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 17 meses: | 5,12% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | 7,26% |
| 7. Nivel de Impago (2): | 6,73% |

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 18 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.

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF



Nº: 3812/14

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA \Infoinver.trimJun14

CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 28/03/14-30/06/14

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|--|---|
| Fecha de Constitución del Fondo | 22 de junio de 2007 |
| Fecha Emisión Bonos | 22 de junio de 2007 |
| Fecha Final Amortización Bonos (6,19% TAA) | 28 de marzo de 2017 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisores Derechos de Crédito | BMN (Caixa Penedés) y Banco Sabadell (Caixa Penedés) |
| Agente de Pagos | BNP PARIBAS |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Fitch Ibcra / Moody's Investors Service |
| Calificación | Bono A:(F) AA (sf) / (M) A3 (sf) Bono B:(F) BBB (sf) / (M) Caa1 (sf) Bono C:(F) B- (sf) / (M) Ca (sf) |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Nombre | Bonos de Titulización CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA |
|---|---|
| Serie A: | |
| Código ISIN | ES0357326000 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 726.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 85.825.469,40 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 11.821,69 Euros |

CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA\INFO.trim\Jun14

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Nombre | Bonos de Titulización CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA |
|---|---|
| Serie B: | |
| Código ISIN | ES0357326018 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 44.600.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 44.600.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie C: | |
| Código ISIN | ES0357326026 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 19.400.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 19.400.000,00 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: 28/03/14-30/06/14
- * Flujos de Caja del Período: 28/03/14-30/06/14
- * Información a los inversores. Fecha de Pago: 30 de Junio de 2014

CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA*Fondo de Titulización de Activos***FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 28/03/14 - 30/06/14**

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | Euros | |
|--|----------------------|----------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 11.099.741,40 |
| Amortización Participaciones Hip. | 10.691.583,54 | |
| Amortización Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 273.345,66 |
| Intereses recibidos de las PHs | 1.033.193,97 | |
| Intereses Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| Intereses Inversiones Temporales | 3.807,72 | |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: | | 28.236,65 |
| Neto SWAP | | 116.461,53 |
| Remuneración Variable Préstamo Participativo | | 0,00 |
| Total Ingresos/Pagos | 11.728.585,23 | 11.517.785,24 |
| Saldo inicial 28/03/14 | 5.956.620,07 | |
| A Inversiones Temporales | | 6.167.420,06 |
| Total | 17.685.205,30 | 17.685.205,30 |
| Retenciones practicadas el 30/06/14 | 57.432,86 | |
| A Inversiones Temporales | | 57.432,86 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 3816/14**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA \flujo.trimJun14