

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO, FTA
Número de registro del Fondo: 9815
NIF Fondo: V86082716
Denominación del compartimento: Ampliación Serie 22 (Emisión 54)
Número de registro del compartimento: 10591
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A-80352750
Fondo Abierto: SI
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:
(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.01

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	16.947.088	1001	18.428.510
I. Activos financieros a largo plazo	0002	16.947.088	1002	18.428.510
1. Activos titulizados	0003	16.947.088	1003	18.428.510
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	0	1005	0
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007	0	1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008	0	1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009	0	1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010	0	1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016	0	1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	0
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022	16.947.088	1022	0
1.20 Otros	0023	0	1023	18.428.510
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	0	1025	0
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	0
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.01

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	2.196.403	1041	2.133.304
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	2.000.030	1043	2.109.944
1. Activos titulizados	0044	1.481.422	1044	1.404.471
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	0	1046	0
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048	0	1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049	0	1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050	0	1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051	0	1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052	0	1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053	0	1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054	0	1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055	0	1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056	0	1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057	0	1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058	0	1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060	0	1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061	0	1061	0
1.18 Bonos de titulización	0062	0	1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063	1.481.422	1063	0
1.20 Otros	0064	0	1064	1.404.471
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	0	1065	0
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	0	1066	0
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	0	1067	0
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	0	1068	0
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	0	1069	0
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	518.608	1074	705.472
3.1 Valores representativos de deuda	0075	0	1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076	0	1076	0
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	518.608	1077	705.472
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	0
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	196.373	1085	23.360
1. Tesorería	0086	196.373	1086	23.360
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	19.143.491	1088	20.561.814

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.01

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	14.770.329	1089	16.323.075
I. Provisiones a largo plazo	0090	200.305	1090	152.805
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	200.305	1092	152.805
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	14.570.024	1094	16.170.270
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	14.570.024	1095	16.170.270
1.1 Series no subordinadas	0096	14.570.024	1096	16.170.270
1.2 Series subordinadas	0097	0	1097	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	0	1101	0
2.1 Préstamo subordinado	0102	0	1102	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	0	1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.01

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) PASIVO CORRIENTE	0117	4.373.162	1117	4.238.739
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	0119	0	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	4.370.448	1123	4.236.056
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	4.370.448	1124	4.236.056
1.1 Series no subordinadas	0125	3.966.338	1125	3.827.421
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	404.111	1128	408.634
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	0	1131	0
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	0	1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	0	1136	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	0	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	0
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	2.714	1148	2.683
1. Comisiones	0149	31	1149	39
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	5	1150	7
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	26	1152	32
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	2.683	1157	2.644
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	0	1158	0
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	0	1160	0
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	19.143.491	1162	20.561.814

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	187.754	1201	216.352	2201	786.078	3201	918.046
1.1 Activos titulizados	0202	187.754	1202	216.352	2202	786.078	3202	918.046
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-169.646	1204	-201.611	2204	-733.508	3204	-867.072
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-169.646	1205	-201.611	2205	-733.508	3205	-867.072
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	0	1206	0	2206	0	3206	0
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	0	1208	0	2208	0	3208	0
A) MARGEN DE INTERESES	0209	18.108	1209	14.741	2209	52.570	3209	50.974
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210	0	3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	56	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-1.418	1217	-14.798	2217	-5.070	3217	-50.974
7.1 Servicios exteriores	0218	-1.176	1218	-1.295	2218	-4.050	3218	-5.443
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-420	1219	-539	2219	-1.042	3219	-2.443
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	-756	1220	-756	2220	-3.008	3220	-3.000
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-242	1224	-13.503	2224	-1.020	3224	-45.531
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-43	1225	-47	2225	-181	3225	-193
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-199	1227	-216	2227	-835	3227	-888
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	-13.240	2228	0	3228	-44.446
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	-4	3230	-4
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	0	2231	0	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	0	2232	0	3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	-16.689	1234	0	2234	-47.500	3234	0
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	-16.689	1236	0	2236	-47.500	3236	0
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238	0	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	0	2239	0	3239	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	96.256	1300	62.063	2300	113.085	3300	3.526
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	97.244	1301	63.072	2301	117.133	3301	7.611
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	194.438	1302	228.014	2302	889.179	3302	964.062
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-97.226	1303	-164.941	2303	-772.046	3303	-956.451
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	32	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-988	1309	-1.009	2309	-4.048	3309	-4.085
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-43	1310	-47	2310	-182	3310	-194
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-197	1312	-215	2312	-841	3312	-891
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	-748	1314	-748	2314	-3.025	3314	-3.000
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	0	1315	0	2315	0	3315	0
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-90.554	1322	-397.364	2322	59.928	3322	-991.565
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	1.060.535	1323	1.027.237	2323	2.398.516	3323	2.324.943
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-1.150.550	1325	-1.423.953	2325	-2.336.765	3325	-3.314.334
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	349.450	1326	326.047	2326	1.488.235	3326	1.285.666
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	0	1327	0	2327	0	3327	0
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	0	1328	0	2328	0	3328	0
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-1.500.000	1331	-1.750.000	2331	-3.825.000	3331	-4.600.000
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-539	1332	-649	2332	-1.823	3332	-2.173
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	-58	1335	-376	2335	-778	3335	-1.282
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-481	1336	-273	2336	-1.045	3336	-891
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	5.702	1337	-335.301	2337	173.013	3337	-988.038
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	190.672	1338	358.662	2338	23.360	3338	1.011.399
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	196.373	1339	23.360	2339	196.373	3339	23.360

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	0	1357	0	2357	0	3357	0
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	0	1358	0	2358	0	3358	0
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359	0	3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	0	1360	0	2360	0	3360	0
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361	0	3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	0	1362	0	2362	0	3362	0
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.1

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: ENDESA, IBERDROLA, E.ON ESPAÑA, E.ON GENERACIÓN, GAS NATURAL SDG, UNIÓN ELÉCTRICA DE CANARIAS GENERACIÓN, ELCOGÁS, GAS Y ELECTRICIDAD GENERACION, ENDESA GENERACIÓN, HIDROELÉCTRICA DEL CANTÁBRICO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2016								Situación cierre anual anterior 31/12/2015								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381		0401		0421		0441		1381		1401		1421		1441		2381		2401		2421		2441	
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Prestamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399	0,00	0419	0,00	0439	0,00	0459	0,00	1399	0,00	1419	0,00	1439	0,00	1459	0,00	2399	0,00	2419	0,00	2439	0,00	2459	0,00

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.1

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: ENDESA, IBERDROLA, E.ON ESPAÑA, E.ON GENERACIÓN, GAS NATURAL SDG, UNIÓN ELÉCTRICA DE CANARIAS GENERACIÓN, ELCOGÁS, GAS Y ELECTRICIDAD GENERACION, ENDESA GENERACIÓN, HIDROELÉCTRICA DEL CANTÁBRICO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe Impagado								Principal pendiente no vencido	Otros importes		Deuda Total		
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	0	0467	0	0474	0	0481	0	0488	0	0495	0	0502	0	0509	0
De 1 a 3 meses	0461	0	0468	0	0475	0	0482	0	0489	0	0496	0	0503	0	0510	0
De 3 a 6 meses	0462	0	0469	0	0476	0	0483	0	0490	0	0497	0	0504	0	0511	0
De 6 a 9 meses	0463	0	0470	0	0477	0	0484	0	0491	0	0498	0	0505	0	0512	0
De 9 a 12 meses	0464	0	0471	0	0478	0	0485	0	0492	0	0499	0	0506	0	0513	0
Más de 12 meses	0465	0	0472	0	0479	0	0486	0	0493	0	0500	0	0507	0	0514	0
Total	0466	0	0473	0	0480	0	0487	0	0494	0	0501	0	0508	0	1515	0

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos		Importe Impagado								Principal pendiente no vencido	Otros importes		Deuda Total		Valor garantía		Valor Garantía con Tasación > 2 años		% Deuda / v. Tasación		
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total													
Hasta 1 mes	0515	0	0522	0	0529	0	0536	0	0543	0	0550	0	0557	0	0564	0	0571	0	0578	0	0584	0,00
De 1 a 3 meses	0516	0	0523	0	0530	0	0537	0	0544	0	0551	0	0558	0	0565	0	0572	0	0579	0	0585	0,00
De 3 a 6 meses	0517	0	0524	0	0531	0	0538	0	0545	0	0552	0	0559	0	0566	0	0573	0	0580	0	0586	0,00
De 6 a 9 meses	0518	0	0525	0	0532	0	0539	0	0546	0	0553	0	0560	0	0567	0	0574	0	0581	0	0587	0,00
De 9 a 12 meses	0519	0	0526	0	0533	0	0540	0	0547	0	0554	0	0561	0	0568	0	0575	0	0582	0	0588	0,00
Más de 12 meses	0520	0	0527	0	0534	0	0541	0	0548	0	0555	0	0562	0	0569	0	0576	0	0583	0	0589	0,00
Total	0521	0	0528	0	0535	0	0542	0	0549	0	0556	0	0563	0	0570	0	0577	0			0590	0,00

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.1

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: ENDESA, IBERDROLA, E.ON ESPAÑA, E.ON GENERACIÓN, GAS NATURAL SDG, UNIÓN ELÉCTRICA DE CANARIAS GENERACIÓN, ELCOGÁS, GAS Y ELECTRICIDAD GENERACION, ENDESA GENERACIÓN, HIDROELÉCTRICA DEL CANTÁBRICO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 23/11/2010	
Inferior a 1 año	0600	0	1600	0	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	0	1601	0	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	0	1602	0	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	0	1603	0	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	0	1604	0	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	6.932.235	1605	0	2605	0
Superior a 10 años	0606	11.496.275	1606	19.832.981	2606	24.189.838
Total	0607	18.428.510	1607	19.832.981	2607	24.189.838
Vida residual media ponderada (años)	0608	10,35	1608	11,35	2608	14,94

Antigüedad	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 23/11/2010	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	4,49	1609	3,50	2609	0,00

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.1

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: ENDESA, IBERDROLA, E.ON ESPAÑA, E.ON GENERACIÓN, GAS NATURAL SDG, UNIÓN ELÉCTRICA DE CANARIAS GENERACIÓN, ELCOGÁS, GAS Y ELECTRICIDAD GENERACION, ENDESA GENERACIÓN, HIDROELÉCTRICA DEL CANTÁBRICO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 23/11/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	0	0630	0	1620	0	1630	0	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	0	0631	0	1621	0	1631	0	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	0	0632	0	1622	0	1632	0	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	0	0633	0	1623	0	1633	0	2623	0	2633	0
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	0	0638	0	1628	0	1638	0	2628	0	2638	0
Media ponderada (%)			0639	0,00			1639	0,00			2639	0,00

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.1

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: ENDESA, IBERDROLA, E.ON ESPAÑA, E.ON GENERACIÓN, GAS NATURAL SDG, UNIÓN ELÉCTRICA DE CANARIAS GENERACIÓN, ELCOGÁS, GAS Y ELECTRICIDAD GENERACION, ENDESA GENERACIÓN, HIDROELÉCTRICA DEL CANTÁBRICO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 23/11/2010	
Tipo de interés medio ponderado	0650	4,09	1650	4,53	2650	4,83
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,09	1651	4,53	2651	8,11
Tipo de interés nominal mínimo	0652	4,09	1652	4,53	2652	2,69

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.1

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: ENDESA, IBERDROLA, E.ON ESPAÑA, E.ON GENERACIÓN, GAS NATURAL SDG, UNIÓN ELÉCTRICA DE CANARIAS GENERACIÓN, ELCOGÁS, GAS Y ELECTRICIDAD GENERACION, ENDESA GENERACIÓN, HIDROELÉCTRICA DEL CANTÁBRICO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 23/11/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	0	0683	0	1660	0	1683	0	2660	0	2683	0
Aragón	0661	0	0684	0	1661	0	1684	0	2661	0	2684	0
Asturias	0662	0	0685	0	1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663	0	0686	0	1663	0	1686	0	2663	0	2686	0
Canarias	0664	0	0687	0	1664	0	1687	0	2664	0	2687	0
Cantabria	0665	0	0688	0	1665	0	1688	0	2665	0	2688	0
Castilla-León	0666	0	0689	0	1666	0	1689	0	2666	0	2689	0
Castilla La Mancha	0667	0	0690	0	1667	0	1690	0	2667	0	2690	0
Cataluña	0668	0	0691	0	1668	0	1691	0	2668	0	2691	0
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	0	2693	0
Galicia	0671	0	0694	0	1671	0	1694	0	2671	0	2694	0
Madrid	0672	43	0695	18.428.510	1672	43	1695	19.832.981	2672	43	2695	24.189.838
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	0	0697	0	1674	0	1697	0	2674	0	2697	0
Navarra	0675	0	0698	0	1675	0	1698	0	2675	0	2698	0
La Rioja	0676	0	0699	0	1676	0	1699	0	2676	0	2699	0
Comunidad Valenciana	0677	0	0700	0	1677	0	1700	0	2677	0	2700	0
País Vasco	0678	0	0701	0	1678	0	1701	0	2678	0	2701	0
Total España	0679	43	0702	18.428.510	1679	43	1702	19.832.981	2679	43	2702	24.189.838
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	43	0705	18.428.510	1682	43	1705	19.832.981	2682	43	2705	24.189.838

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.1
Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016
Entidades cedentes de los activos titulizados: ENDESA, IBERDROLA, E.ON ESPAÑA, E.ON GENERACIÓN, GAS NATURAL SDG, UNIÓN ELÉCTRICA DE CANARIAS GENERACIÓN, ELCOGÁS, GAS Y ELECTRICIDAD GENERACION, ENDESA GENERACIÓN, HIDROELÉCTRICA DEL CANTÁBRICO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 23/11/2010			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	100,00			1710	100,00			2710	100,00		
Sector	0711	100,00	0712	35	1711	100,00	1712	35	2711	100,00	2712	35

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.2

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016			Situación cierre anual anterior 31/12/2015			Situación inicial 23/11/2010		
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722
ES0378641007	Serie 1	0	0	0	0	0	0	25.050	100.000	2.505.000
ES0378641015	Serie 2	0	0	0	0	0	0	28.500	100.000	2.850.000
ES0378641023	Serie 3	26.490	100.000	2.649.000	26.490	100.000	2.649.000	26.490	100.000	2.649.000
ES0378641031	Serie 4	22.250	100.000	2.225.000	22.250	100.000	2.225.000	22.250	100.000	2.225.000
ES0378641049	Serie 5	0	0	0	0	0	0	20.660	100.000	2.066.000
ES0378641056	Serie 6	2.000	100.000	200.000	2.000	100.000	200.000	2.000	100.000	200.000
ES0378641064	Serie 7	1.250	100.000	125.000	1.250	100.000	125.000	1.250	100.000	125.000
ES0378641072	Serie 8	0	0	0	0	0	0	2.000	100.000	200.000
ES0378641080	Serie 9	6.088	100.000	608.800	4.923	100.000	492.300	6.088	100.000	608.800
ES0378641098	Serie 10	6.420	100.000	642.000	5.800	100.000	580.000	6.420	100.000	642.000
ES0378641106	Serie 11	1.250	100.000	125.000	1.250	100.000	125.000	1.250	100.000	125.000
ES0378641114	Serie 12	9.440	100.000	944.000	9.440	100.000	944.000	9.440	100.000	944.000
ES0378641122	Serie 13	0	0	0	0	0	0	17.500	100.000	1.750.000
ES0378641130	Serie 14	12.320	100.000	1.232.000	12.320	100.000	1.232.000	12.320	100.000	1.232.000
ES0378641148	Serie 15	890	100.000	89.000	890	100.000	89.000	890	100.000	89.000
ES0378641155	Serie 16	18.250	100.000	1.825.000	18.250	100.000	1.825.000	18.250	100.000	1.825.000
ES0378641163	Serie 17	0	0	0	23.250	100.000	2.325.000	23.250	100.000	2.325.000
ES0378641171	Serie 18	21.250	100.000	2.125.000	21.250	100.000	2.125.000	21.250	100.000	2.125.000
ES0378641189	Serie 19	0	0	0	15.000	100.000	1.500.000	15.000	100.000	1.500.000
ES0378641197	Serie 20	17.870	100.000	1.787.000	17.870	100.000	1.787.000	17.870	100.000	1.787.000
ES0378641205	Serie 21	20.100	100.000	2.010.000	16.300	100.000	1.630.000	20.100	100.000	2.010.000
ES0378641213	Serie 22	1.500	100.000	150.000	1.500	100.000	150.000	1.500	100.000	150.000
ES0378641221	Serie 23	1.200	100.000	120.000	0	0	0	1.200	100.000	120.000
ES0378641239	Serie 24	8.560	100.000	856.000	0	0	0	8.560	100.000	856.000
ES0378641247	Serie 26	2.000	100.000	200.000	0	0	0	2.000	100.000	200.000
ES0378641254	Serie 25	3.200	100.000	320.000	0	0	0	3.200	100.000	320.000

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

ES0378641262	Serie 27		700	100.000		70.000		0	0		0		700	100.000		70.000
ES0378641270	Serie 28		1.880	100.000		188.000		0	0		0		1.880	100.000		188.000
Total		0723	184.908		0724	18.490.80 0	1723	200.033		1724	20.003.30 0	2723	316.868		2724	31.686.80 0

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.2

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado	0738	0739
						0734	0735	0742	0736	0737		
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739
ES0378641007	Serie 1	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	SI	0	0	0	0
ES0378641015	Serie 2	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	SI	0	0	0	0
ES0378641023	Serie 3	NS	Tipo Fijo	0,00	5,90	123.748	0	SI	2.649.000	0	2.772.748	0
ES0378641031	Serie 4	NS	Tipo Fijo	0,00	5,60	35.844	0	SI	2.225.000	0	2.260.844	0
ES0378641049	Serie 5	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	SI	0	0	0	0
ES0378641056	Serie 6	NS	Tipo Fijo	0,00	5,00	384	0	SI	200.000	0	200.384	0
ES0378641064	Serie 7	NS	Tipo Fijo	0,00	5,00	3.373	0	SI	125.000	0	128.373	0
ES0378641072	Serie 8	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	SI	0	0	0	0
ES0378641080	Serie 9	NS	Tipo Fijo	0,00	6,25	28.755	0	SI	608.800	0	637.555	0
ES0378641098	Serie 10	NS	Tipo Fijo	0,00	6,46	32.600	0	SI	642.000	0	674.600	0
ES0378641106	Serie 11	NS	Tipo Fijo	0,00	6,50	6.433	0	SI	125.000	0	131.433	0
ES0378641114	Serie 12	NS	Tipo Fijo	0,00	4,88	1.765	0	SI	944.000	0	945.765	0
ES0378641122	Serie 13	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	SI	0	0	0	0
ES0378641130	Serie 14	NS	Tipo Fijo	0,00	4,13	40.238	0	SI	1.232.000	0	1.272.238	0
ES0378641148	Serie 15	NS	Tipo Fijo	0,00	5,75	196	0	SI	89.000	0	89.196	0
ES0378641155	Serie 16	NS	Tipo Fijo	0,00	3,88	55.994	0	SI	1.825.000	0	1.880.994	0
ES0378641163	Serie 17	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	SI	0	0	0	0
ES0378641171	Serie 18	NS	Tipo Fijo	0,00	3,38	56.786	0	SI	2.125.000	0	2.181.786	0
ES0378641189	Serie 19	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	SI	0	0	0	0
ES0378641197	Serie 20	NS	Tipo Fijo	0,00	1,88	9.639	0	SI	1.787.000	0	1.796.639	0
ES0378641205	Serie 21	NS	Tipo Fijo	0,00	0,85	4.915	0	SI	2.010.000	0	2.014.915	0
ES0378641213	Serie 22	NS	Tipo Fijo	0,00	1,45	1.174	0	SI	150.000	0	151.174	0
ES0378641221	Serie 23	NS	Tipo Fijo	0,00	1,80	1.302	0	SI	120.000	0	121.302	0
ES0378641239	Serie 24	NS	Tipo Fijo	0,00	0,50	164	0	SI	856.000	0	856.164	0
ES0378641247	Serie 26	NS	Tipo Fijo	0,00	1,00	433	0	SI	200.000	0	200.433	0

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

ES0378641254	Serie 25	NS	Tipo Fijo	0,00	0,13	87	0	SI	320.000	0	320.087	0					
ES0378641262	Serie 27	NS	Tipo Fijo	0,00	0,00	0	0	SI	70.000	0	70.000	0					
ES0378641270	Serie 28	NS	Tipo Fijo	0,00	0,75	282	0	SI	188.000	0	188.282	0					
Total						0740	404.111	0741	0	0743	18.490.800	0744	0	0745	18.894.911	0746	0

	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 23/11/2010			
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	3,76	0748	3,95	0749	3,86

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.2

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016				Situación periodo comparativo anterior 31/12/2015			
Serie	Denominación serie	Amortización principal		Intereses		Amortización principal		Intereses	
		Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753
ES0378641007	Serie 1	0	2.505.000	0	374.134	0	2.505.000	0	374.134
ES0378641015	Serie 2	0	2.850.000	0	600.959	0	2.850.000	0	600.959
ES0378641023	Serie 3	0	0	0	719.110	0	0	0	562.819
ES0378641031	Serie 4	0	0	0	568.611	0	0	0	444.011
ES0378641049	Serie 5	0	2.066.000	0	177.337	0	2.066.000	0	177.337
ES0378641056	Serie 6	0	0	10.000	46.660	0	0	10.000	36.660
ES0378641064	Serie 7	0	0	0	28.159	0	0	0	21.909
ES0378641072	Serie 8	0	200.000	0	19.378	0	200.000	0	19.378
ES0378641080	Serie 9	0	0	0	125.033	0	0	0	94.264
ES0378641098	Serie 10	0	0	0	152.534	0	0	0	115.066
ES0378641106	Serie 11	0	0	0	32.922	0	0	0	24.797
ES0378641114	Serie 12	0	0	46.020	216.232	0	0	46.020	170.212
ES0378641122	Serie 13	0	1.750.000	0	211.151	1.750.000	1.750.000	70.000	211.151
ES0378641130	Serie 14	0	0	0	139.536	0	0	0	88.716
ES0378641148	Serie 15	0	0	5.118	19.643	0	0	5.118	14.525
ES0378641155	Serie 16	0	0	0	211.381	0	0	0	140.662
ES0378641163	Serie 17	0	2.325.000	0	219.955	0	0	0	153.111
ES0378641171	Serie 18	0	0	0	175.662	0	0	0	103.943
ES0378641189	Serie 19	1.500.000	1.500.000	33.750	104.856	0	0	33.750	71.106
ES0378641197	Serie 20	0	0	0	77.659	0	0	0	44.152
ES0378641205	Serie 21	0	0	0	20.112	0	0	0	3.027
ES0378641213	Serie 22	0	0	0	1.456	0	0	0	0
ES0378641221	Serie 23	0	0	0	0	0	0	0	0
ES0378641239	Serie 24	0	0	2.339	2.339	0	0	0	0
ES0378641247	Serie 26	0	0	0	0	0	0	0	0

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

ES0378641254	Serie 25	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0378641262	Serie 27	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0378641270	Serie 28	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Total		0754	1.500.000	0755	13.196.000	0756	97.226	0757	4.244.817	1754	1.750.000	1755	9.371.000	1756	164.888	1757	3.471.939

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.2

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 23/11/2010
				0762	0763	0764
ES0378641007	Serie 1	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641007	Serie 1	08/06/2012	FCH	BBB	BBB	AA+
ES0378641007	Serie 1	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Aa1
ES0378641007	Serie 1	16/10/2012	SYP	BBB-	BBB-	AA
ES0378641015	Serie 2	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641015	Serie 2	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	AA+
ES0378641015	Serie 2	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Aa1
ES0378641015	Serie 2	23/05/2014	SYP	BBB	BBB	AA
ES0378641023	Serie 3	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641023	Serie 3	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	AA+
ES0378641023	Serie 3	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Aa2
ES0378641023	Serie 3	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	AA
ES0378641031	Serie 4	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641031	Serie 4	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	AA+
ES0378641031	Serie 4	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Aa2
ES0378641031	Serie 4	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	AA
ES0378641049	Serie 5	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641049	Serie 5	08/06/2012	FCH	BBB	BBB	AA+
ES0378641049	Serie 5	22/06/2012	MDY	Baa3	Baa3	Aa2
ES0378641049	Serie 5	16/10/2012	SYP	BBB-	BBB-	AA
ES0378641056	Serie 6	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641056	Serie 6	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	AA-
ES0378641064	Serie 7	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641064	Serie 7	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	AA-
ES0378641072	Serie 8	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641072	Serie 8	16/10/2012	SYP	BBB-	BBB-	A

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

ES0378641080	Serie 9	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641080	Serie 9	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	A
ES0378641098	Serie 10	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641098	Serie 10	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	A
ES0378641098	Serie 10	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	A3
ES0378641098	Serie 10	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	A
ES0378641106	Serie 11	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641106	Serie 11	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	A
ES0378641114	Serie 12	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641114	Serie 12	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	A
ES0378641122	Serie 13	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641122	Serie 13	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	BBB
ES0378641122	Serie 13	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Baa3
ES0378641122	Serie 13	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	BBB-
ES0378641130	Serie 14	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641130	Serie 14	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	BBB
ES0378641130	Serie 14	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Baa3
ES0378641130	Serie 14	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	BBB-
ES0378641148	Serie 15	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641148	Serie 15	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	BBB-
ES0378641155	Serie 16	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641155	Serie 16	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	BBB
ES0378641155	Serie 16	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Baa3
ES0378641155	Serie 16	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	BBB-
ES0378641163	Serie 17	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641163	Serie 17	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	BBB
ES0378641163	Serie 17	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Baa3
ES0378641163	Serie 17	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	BBB-
ES0378641171	Serie 18	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641171	Serie 18	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	BBB
ES0378641171	Serie 18	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Baa3
ES0378641171	Serie 18	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	BBB-
ES0378641189	Serie 19	16/09/2013	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641189	Serie 19	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	BBB
ES0378641189	Serie 19	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Baa3
ES0378641189	Serie 19	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	BBB-
ES0378641197	Serie 20	21/02/2014	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641197	Serie 20	30/04/2014	FCH	BBB+	BBB+	BBB
ES0378641197	Serie 20	25/02/2014	MDY	Baa2	Baa2	Baa3
ES0378641197	Serie 20	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	BBB-
ES0378641205	Serie 21	09/06/2015	DBRS	A (low)	A (low)	A (low)
ES0378641205	Serie 21	09/06/2015	FCH	BBB+	BBB+	BBB+

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

ES0378641205	Serie 21	09/06/2015	MDY	Baa2	Baa2	Baa2
ES0378641205	Serie 21	02/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	BBB
ES0378641213	Serie 22	16/10/2015	SYP	BBB+	BBB+	BBB+
ES0378641221	Serie 23	25/05/2016	SYP	BBB+		BBB+
ES0378641239	Serie 24	31/05/2016	SYP	BBB+		BBB+
ES0378641247	Serie 26	13/10/2016	SYP	BBB+		BBB+
ES0378641254	Serie 25	13/10/2016	SYP	BBB+		BBB+
ES0378641262	Serie 27	17/10/2016	MDY	Baa2		Baa2
ES0378641262	Serie 27	17/10/2016	SYP	BBB+		BBB+
ES0378641270	Serie 28	19/10/2016	MDY	Baa2		Baa2
ES0378641270	Serie 28	19/10/2016	SYP	BBB+		BBB+

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.2

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 23/11/2010	
Inferior a 1 año	0765		1765	3.825.000	2765	
Entre 1 y 2 años	0766	519.000	1766	3.963.000	2766	2.585.000
Entre 2 y 3 años	0767		1767	4.050.000	2767	1.230.000
Entre 3 y 4 años	0768	2.280.000	1768	3.755.000	2768	10.180.000
Entre 4 y 5 años	0769	5.701.000	1769		2769	7.701.000
Entre 5 y 10 años	0770	8.197.500	1770	4.410.300	2770	8.197.500
Superior a 10 años	0771	1.793.300	1771		2771	1.793.300
Total	0772	18.490.800	1772	20.003.300	2772	31.686.800
Vida residual media ponderada (años)	0773	3,08	1773	3,20	2773	5,06

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.3

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 23/11/2010	
1	Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775		1775		2775	
1.1	Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776		1776		2776	
1.2	Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777		1777		2777	
1.3	Denominación de la contrapartida	0778		1778		2778	
1.4	Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5	Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2	Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	2.000.000	1781	2.000.000	2781	2.000.000
2.1	Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	10,82	1782	10,00	2782	6,31
2.2	Denominación de la contrapartida	0783	ICO	1783	ICO	2783	ICO
2.3	Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4	Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3	Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	18.490.800	1786	20.003.300	2786	26.000.000
3.1	Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	100,00	1787	100,00	2787	82,05
3.2	Denominación de la entidad avalista	0788	Administración General del Estado	1788	Administración General del Estado	2788	Administración General del Estado
3.3	Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4	Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4	Subordinación de series (S/N)	0791	N	1791	N	2791	N
4.1	Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100,00	1792	100,00	2792	100,00
5	Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1	Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2	Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3	Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.3

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características		
Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 23/11/2010			
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806		
Total						0808		0809		0810	

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.3

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 23/11/2010		Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 23/11/2010			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.4

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto		
					Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Última Fecha Pago
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002		7003		7006		7009		7012		7015		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016		
Total Morosos					7005		7008		7011		7014		7017		7018
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019		7020		7021		7024		7027		7030		7033		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022		7025		7028		7031		7034		
Total Fallidos					7023		7026		7029		7032		7035		7036

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto		
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Última Fecha Pago
	0850		1850		2850		3850
	0851		1851		2851		3851
	0852		1852		2852		3852
	0853		1853		2853		3853

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.4

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO


CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.5

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862		2862	Saldo Nominal Pendiente de Pago de los Bonos en fecha de Pago inmediatamente anterior a la Fecha de Pago.	3862	0,001	4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	Instituto de Crédito Oficial	1864	15	2864	Saldo Nominal Pendiente de Pago de los Bonos en la Fecha de Pago inmediatamente anterior.	3864	0,004	4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.5
Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	N
3 Otros (S/N)	0868	S
3.1 Descripción	0869	En la Fecha de Liquidación del Fondo, el remanente en las Cuentas del Fondo se transferirá a la CNMC.
Contrapartida	0870	CNMC
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Documento de Registro de Valores de Titulización 4.4.3.

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo											Total		
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872														
Margen de intereses	0873														
Deterioro de activos financieros (neto)	0874														
Dotaciones a provisiones (neto)	0875														
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876														
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877														
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878														
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879														
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880														
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881														
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882														
Comisión variable pagada	0883														
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884														

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.05.5
Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885												
Saldo inicial	0886												
Cobros del periodo	0887												
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888												
Pagos por derivados	0889												
Retención importe Fondo de Reserva	0890												
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891												
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892												
Resto pagos/retenciones	0893												
Saldo disponible	0894												
Liquidación de comisión variable	0895												

FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

S.06

Denominación Fondo: FONDO DE TITULIZACIÓN DEL DÉFICIT DEL SISTEMA ELÉC

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

INFORME SOBRE EL CUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE RIESGOS