

TDA 19-MIXTO - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 22/03/16 - 22/06/16

	Euros
	Total
I. Situación al 22/03/16:	11.693.038,20
Saldo inicial Fondo de Reserva	11.693.038,20
II. Fondos recibidos del emisor	4.670.051,60
Principal:	
Según calendario 31/05/16:	3.121.808,20
Amort. Anticipada hasta 31/05/16:	893.902,82
Intereses:	654.340,58
III. Subtotal Cuenta de reinversión (I + II):	16.363.089,80
IV. Total intereses de la reinversión:	-5.204,19
Intereses de la Cta. De Tesorería	-4.664,09
Intereses de la Cta. De Cobros	-540,10
V. Recursos disponibles (III + IV):	16.357.885,61
VI. Gastos:	25.168,95
VII. Liquidación SWAP:	-364.924,85
Cantidad a Pagar por la Parte A (JP Morgan):	-45.809,04
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	319.115,81
VIII. Pago a los Bonos:	3.781.907,76
Bonos A:	
Intereses correspondientes al 22/06/16:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 22/06/16:	3.371.293,71
Bonos B:	
Intereses correspondientes al 22/06/16:	5.089,92
Retenciones practicadas a los bonos:	-967,68
Amortización correspondiente al 22/06/16:	257.182,08
Bonos C:	
Intereses correspondientes al 22/06/16:	5.196,00
Retenciones practicadas a los bonos:	-987,00
Amortización correspondiente al 22/06/16:	85.357,80
Bonos D:	
Intereses correspondientes al 22/06/16:	57.788,25
Retenciones practicadas a los bonos:	-10.980,00
Amortización correspondiente al 22/06/16:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	12.934,68
IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII):	12.185.884,05
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva (22/03/16)	11.693.038,20
Aportación al Fondo de Reserva	0,00
Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada	35.906,43
Amortización Préstamo Participativo	0,00
Remuneración Variable Prést. Participativo	456.939,42
Fondo de Reserva (22/06/16)	11.693.038,20

Destinatarios: CNMV, AIAF.



Nº:2815/16
 Titulización de Activos, SGFT,S.
 Orense, 69
 28020 Madrid
 Tel.:917020808
<http://www.tda-sgft.com>
TDA19liq.trimJun16

TDA 19 - MIXTO

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 22 de Junio de 2016

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:	98.536.889,85 €	17.369,45 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	3.371.293,71 €	594,27 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	95.165.596,14 €	16.775,18 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	16,775180%	16,775180%
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:	7.516.913,28 €	39.150,59 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	5.089,92 €	26,51 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	257.182,08 €	1.339,49 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	7.259.731,20 €	37.811,10 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	37,811100%	37,811100%
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:	2.494.835,40 €	41.580,59 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	5.196,00 €	86,60 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	85.357,80 €	1.422,63 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	2.409.477,60 €	40.157,96 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	40,157960%	40,157960%
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:	57.788,25 €	770,51 €
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 31/05/16:		
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:		111.760.572,42 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:		3.024.220,52 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:		111.876.102,86 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:		3.508.805,34 €
2. Amortización del período 29/02/16 a 31/05/16:		
a) Según calendario:		4.015.711,02 €
b) Amortización anticipada hasta 31/05/16:		3.121.808,20 €
		893.902,82 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):		
a) Último año:		3,05%
b) Último semestre:		3,57%
c) Último trimestre:		3,06%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:		0,71%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:		0,24%
6. Porcentaje de fallidos (1):		3,04%
7. Nivel de Impago(2):		0,37%

(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 periodo 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: 2816/16

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.
Orense, 69

28020 Madrid
Tel.: 917020808

http://www.tda-sgft.com
TDA19InfoInver.trimJun16

TDA 19-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 22/03/16 - 22/06/16

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 (3,05% TAA)	22 de junio de 2021
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca	Cajamar Catalunya Banc (C. Tarragona)
Agente de Pagos	BNP PARIBAS
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Moody's Investors Service/ Fitch Ibc
Calificación	Bono A: Aa2 (sf) (M) / AA+ (sf) (F) Bono B: Aa2 (sf) (M) / AA+ (sf) (F) Bono C: Aa3 (sf) (M) / AA (sf) (F) Bono D: Baa3 (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)	95.165.596,14 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.00,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	16.775,18 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES 0377964012
Nominal en circulación total (inicial)	19.200.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	7.259.731,20 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	37.811,10 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)	2.409.477,60 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	40.157,96 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: 22/03/16 - 22/06/16
* Flujos de Caja del Período: 22/03/16 - 22/06/16
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Junio de 2016

TDA 19-MIXTO**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/03/16 - 22/06/16**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip. Amortización Participaciones Hip.	4.015.711,02	3.713.833,59
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH Intereses recibidos de las PHs Intereses Ptmos. Subordinados Intereses Inversiones Temporales	654.340,58 -5.204,19	68.074,17 35.906,43
III. GASTOS		
Comisiones Periódicas: Neto swap a favor de JP Morgan Remuneración Variable Préstamo Participativo		25.168,95 364.924,85 456.939,42
Total Ingresos/Pagos	4.664.847,41	4.664.847,41
Saldo inicial 22/03/16 A Inversiones Temporales	11.693.038,20	11.693.038,20
Total	16.357.885,61	16.357.885,61
Retenciones practicadas el 22/06/16 A Inv.Temporales	12.934,68	12.934,68

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 2822/16**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA 19flujo.trimJun16