

TDA 24 - Fondo de Titulización de Activos
LIQUIDACION DEL PERIODO 22/06/21 - 22/09/21

| | Euros |
|---|---------------------|
| | TOTAL |
| I. Situación Inicial | 3,03 |
| Fondo Reserva | 0,00 |
| Saldo Inicial Cuenta Tesorería | 3,03 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 2.837.576,93 |
| Principal: | |
| Según calendario hasta 31/08/21: | 1.788.194,54 |
| Amort. Anticipada hasta 31/08/21: | 885.708,04 |
| Intereses: | 163.674,35 |
| Ingresos por venta de inmuebles | 0,00 |
| III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II): | 2.837.579,96 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | -3.692,00 |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | -1.542,32 |
| Intereses de la Cta. De Cobros | -2.149,68 |
| Intereses de la Cta. De Amortización Línea Liquidez | 0,00 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 2.833.887,96 |
| VI. Varios: | 164.262,30 |
| VII. Liquidación SWAP: | -343.534,61 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (J P Morgan): | -76.328,22 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo): | 267.206,39 |
| VIII. Línea Liquidez | 0,00 |
| Intereses | 0,00 |
| Amortización | 0,00 |
| IX. Pago a los Bonos: | 2.326.089,10 |
| Bonos A2: | |
| Intereses correspondientes al 22/09/21: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 22/09/21: | 2.326.089,10 |
| Bonos B: | |
| Intereses correspondientes al 22/09/21: | 0,00 |
| Intereses pagados a 22/09/21: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Intereses impagados a 22/09/21: | 285.664,05 |
| Amortización correspondiente al 22/09/21: | 0,00 |
| Bonos C: | |
| Intereses vencidos a 22/09/21: | 1.159,11 |
| Intereses pagados a 22/09/21: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Intereses impagados a 22/09/21: | 501.358,41 |
| Amortización correspondiente al 22/09/21: | 0,00 |
| Bonos D: | |
| Intereses vencidos a 22/09/21: | 18.604,50 |
| Intereses pagados a 22/09/21: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Intereses impagados a 22/09/21: | 1.152.328,00 |
| Amortización correspondiente al 22/09/21: | 0,00 |
| Reinversión o devolución de las retenciones: | 0,00 |
| X. Saldo disponible : | 1,95 |
| Distribución del saldo disponible: | |
| Fondo de Reserva previo 22/06/21: | 0,00 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 0,00 |
| Cantidad Dotada Línea Liquidez 22/09/21 | 0,00 |
| Recursos para próximo pago | 1,95 |
| Margen de Intermediación Financiera | 0,00 |
| Fondo de Reserva 22/09/21: | 0,00 |

Destinatarios: CNMV; AIAF



Nº: 3441/21
Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.:917020808
http://www.tda-sgft.com
TDA24liq.trimSep21

Fondo de Titulización de Activos

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 22 de Septiembre de 2021

Importes en euros

| I. BONOS A2 ES0377952017 | | Sobre 970 bonos | Por Bono |
|---|--|-----------------|--------------|
| 1. Saldo inicial (01/12/05): | | 97.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | | 60.269.107,00 € | 62.133,10 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | | 2.326.089,10 € | 2.398,03 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | | 57.943.017,90 € | 59.735,07 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | | 59,735070% | 59,735070% |

| II. BONOS B ES0377952025 | | Sobre 135 bonos | Por Bono |
|---|--|-----------------|--------------|
| 1. Saldo inicial (01/12/05): | | 13.500.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | | 13.500.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago: | | 285.664,05 € | 2.116,03 € |
| 6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | | 13.500.000,00 € | 100.000,00 € |
| 8. Porcentaje pendiente de vencimiento: | | 100,000000% | 100,000000% |

| III. BONOS C ES0377952033 | | Sobre 81 bonos | Por Bono |
|---|--|----------------|--------------|
| 1. Saldo inicial (01/12/05): | | 8.100.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | | 8.100.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago: | | 1.159,11 € | 14,31 € |
| 4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago: | | 501.358,41 € | 6.189,61 € |
| 6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | | 8.100.000,00 € | 100.000,00 € |
| 8. Porcentaje pendiente de vencimiento: | | 100,000000% | 100,000000% |

| IV. BONOS D ES0377952041 | | Sobre 50 bonos | Por Bono |
|---|--|----------------|--------------|
| 1. Saldo inicial (01/12/05): | | 5.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | | 5.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago: | | 18.604,50 € | 372,09 € |
| 4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago: | | 1.152.328,00 € | 23.046,56 € |
| 6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | | 5.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 8. Porcentaje pendiente de vencimiento: | | 100,000000% | 100,000000% |

| V. EL FONDO | | Importes en euros |
|--|--|-------------------|
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/08/21: | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | | 53.915.288,12 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas: | | 22.480.122,43 € |
| c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | | 53.941.997,72 € |
| d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas: | | 35.512.986,45 € |
| 2. Amortización del periodo 31/05/21 a 31/08/21: | | |
| a) Según calendario: | | 1.788.194,54 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/08/21: | | 885.708,04 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | |
| a) Último año: | | 4,77% |
| b) Último semestre: | | 5,11% |
| c) Último trimestre: | | 6,12% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | | 0,96% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses: | | 0,06% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | | 39,70% |
| 7. Nivel de impago (2) | | 0,35% |

(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 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: Cedentes; CNMV; AIAF,



Nº: 3442/21

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

TDA24\Infoinver.trim|Sep21

TDA 24 , FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 22/06/21-22/09/21

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|--|--|
| Fecha de Constitución del Fondo | 28 de noviembre de 2005 |
| Fecha Emisión Bonos | 28 de noviembre de 2005 |
| Fecha Final Amortización Bonos (4,77% TAA) | 22 de junio de 2028 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca | Credifimo, CaixaBank (Bankpime), Liberbank (Banco Castilla la Mancha) |
| Agente de Pagos | BNP PARIBAS |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Fitch Ibc |
| Calificación | Bono A2:(F) BB (sf) Bono B:(F) CC (sf) Bono C:(F) CC (sf) Bono D:(F) C (sf) |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Nombre | Bonos de Titulización TDA 24 |
|---|------------------------------|
| Serie A2: | |
| Código ISIN | ES0377952017 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 97.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 57.943.017,90 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 59.735,07 Euros |
| Serie B: | |
| Código ISIN | ES0377952025 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 13.500.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 13.500.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie C: | |
| Código ISIN | ES0377952033 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 8.100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 8.100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie D: | |
| Código ISIN | ES0377952041 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 5.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 5.000.000,00 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: 22/06/21-22/09/21
- * Flujos de Caja del Período: 22/06/21-22/09/21
- * Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Septiembre de 2021

TDA 24**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/06/21 - 22/09/21**

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | Euros | |
|--------------------------------------|---------------------|---------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 2.326.089,10 |
| Amortización Participaciones Hip. | 2.673.902,58 | |
| Ingresos por venta de inmuebles | 0,00 | |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados línea de liquidez | | 0,00 |
| Intereses pagados a los BTH | | 0,00 |
| Intereses recibidos de las PHs | 163.674,35 | |
| Intereses Inversiones Temporales | -3.692,00 | |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: | | 164.262,30 |
| Neto SWAP | | 343.534,61 |
| Margen de Intermediación Financiera | | 0,00 |
| Total Ingresos/Pagos | 2.833.884,93 | 2.833.886,01 |
| Saldo inicial 22/06/21 | 3,03 | |
| A Inversiones Temporales | | 1,95 |
| Total | 2.833.887,96 | 2.833.887,96 |
| Retenciones practicadas el 22/09/21 | 0,00 | |
| A Inversiones Temporales | | 0,00 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 3448/21**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA 24\fluj.trim\Sep21