

TDA 24 - Fondo de Titulización de Activos
LIQUIDACION DEL PERIODO 22/03/24 - 24/06/24

	Euros
	TOTAL
I. Situación inicial	1,04
Fondo Reserva	0,00
Saldo Inicial Cuenta Tesorería	1,04
II. Fondos recibidos del emisor	1.969.148,34
Principal:	
Según calendario hasta 31/05/24:	1.236.379,55
Amort. Anticipada hasta 31/05/24:	368.544,92
Intereses:	309.724,73
Ingresos por venta de inmuebles	54.499,14
III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):	1.969.149,38
IV. Total intereses de la reinversión:	17.111,90
Intereses de la Cta. De Tesorería	8.221,78
Intereses de la Cta. De Cobros	8.890,12
Intereses de la Cta. De Amortización Línea Liquidez	0,00
V. Recursos disponibles (III + IV):	1.986.261,28
VI. Varios:	165.954,76
VII. Liquidación SWAP:	9.829,02
Cantidad a Pagar por la Parte A (J P Morgan):	336.699,93
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	326.870,91
VIII. Línea Liquidez	18.543,48
Intereses	16.125,38
Amortización	2.418,10
IX. Pago a los Bonos:	1.811.591,40
Bonos A2:	
Intereses correspondientes al 24/06/24:	407.661,90
Retenciones practicadas a los bonos:	77.455,76
Amortización correspondiente al 24/06/24:	1.403.929,50
Bonos B:	
Intereses correspondientes al 24/06/24:	150.588,45
Intereses pagados a 24/06/24:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados a 24/06/24:	1.113.158,70
Amortización correspondiente al 24/06/24:	0,00
Bonos C:	
Intereses vencidos a 24/06/24:	95.639,94
Intereses pagados a 24/06/24:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados a 24/06/24:	1.042.792,38
Amortización correspondiente al 24/06/24:	0,00
Bonos D:	
Intereses vencidos a 24/06/24:	77.315,00
Intereses pagados a 24/06/24:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados a 24/06/24:	1.682.158,50
Amortización correspondiente al 24/06/24:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	-77.455,76
X. Saldo disponible :	0,66
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo 22/03/24:	0,00
Aportación al Fondo de Reserva	0,00
Cantidad Dotada Línea Liquidez 24/06/24	0,00
Recursos para próximo pago	0,66
Margen de Intermediación Financiera	0,00
Fondo de Reserva 24/06/24:	0,00

Destinatarios: CNMV; AIAF



Nº: 2319/24

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.:917020808
http://www.tda-sgft.com
TDA24liq.trimJun24

Fondo de Titulización de Activos

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 24 de Junio de 2024

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:	38.060.889,10 €	39.238,03 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	407.661,90 €	420,27 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	1.403.929,50 €	1.447,35 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	36.656.959,60 €	37.790,68 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	37,790680%	37,790680%

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:	150.588,45 €	1.115,47 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	1.113.158,70 €	8.245,62 €
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:	95.639,94 €	1.180,74 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	1.042.792,38 €	12.873,98 €
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:	77.315,00 €	1.546,30 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	1.682.158,50 €	33.643,17 €
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 31/05/24:	
a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas:	31.322.997,08 €
b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas:	16.756.261,22 €
c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas:	31.346.245,17 €
d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas:	32.904.831,57 €
2. Amortización del período 29/02/24 a 31/05/24:	1.604.924,47 €
a) Según calendario:	1.236.379,55 €
b) Amortización anticipada hasta 31/05/24:	368.544,92 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):	
a) Último año:	6,26%
b) Último semestre:	5,62%
c) Último trimestre:	4,43%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:	1,01%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:	0,22%
6. Porcentaje de fallidos (1):	51,21%
7. Nivel de Impago (2)	0,80%

(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: 2320/24

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

TDA24\Inforver.trim\Jun24

TDA 24 , FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 22/03/24-24/06/24

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 (7,93% TAA)	23 de junio de 2025
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 Ibca
Calificación	Bono A2:(F) CCC (sf) Bono B:(F) C (sf) Bono C:(F) C (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)	36.656.959,60 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	37.790,68 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: 22/03/24-24/06/24
- * Flujos de Caja del Período: 22/03/24-24/06/24
- * Información a los inversores. Fecha de Pago: 24 de Junio de 2024

TDA 24**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/03/24 - 24/06/24**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	Ingresos	Pagos
Amortización Bonos Titulización Hip.		1.403.929,50
Amortización Participaciones Hip.	1.604.924,47	
Ingresos por venta de inmuebles	54.499,14	
Amortización línea de liquidez		2.418,10
II. INTERESES		
Intereses pagados línea de liquidez		16.125,38
Intereses pagados a los BTH		407.661,90
Intereses recibidos de las PHs	309.724,73	
Intereses Inversiones Temporales	17.111,90	
III. GASTOS		
Comisiones Periódicas:		165.954,76
Neto SWAP	9.829,02	
Margen de Intermediación Financiera		0,00
Total Ingresos/Pagos	1.996.089,26	1.996.089,64
Saldo inicial 22/12/23	1,04	
A Inversiones Temporales		0,66
Total	1.996.090,30	1.996.090,30
Retenciones practicadas el 22/03/24	77.455,76	
A Inversiones Temporales		77.455,76

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 2326/24**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA 24\fluj.trim\Jun24