

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8605
NIF Fondo: V84925569
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2024

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)

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	115.692	1001	125.297
I. Activos financieros a largo plazo	0002	115.692	1002	125.297
1. Activos titulizados	0003	115.692	1003	125.297
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	94.544	1004	102.608
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	9.462	1005	10.215
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	0	1022	0
1.20 Otros	0023	0	1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	11.686	1025	12.474
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

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	34.960	1041	35.317
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	13.751	1042	13.892
V. Activos financieros a corto plazo	0043	17.567	1043	18.063
1. Activos titulizados	0044	17.369	1044	18.050
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	8.850	1045	9.240
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	804	1046	821
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	0	1063	0
1.20 Otros	0064	0	1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	251	1065	269
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	32	1066	34
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	7.291	1067	7.540
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	192	1068	198
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-52	1069	-52
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	199	1074	12
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	188	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	11	1079	12
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
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	3.641	1085	3.363
1. Tesorería	0086	3.641	1086	3.363
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	150.652	1088	160.614

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	130.265	1089	140.498
I. Provisiones a largo plazo	0090	0	1090	0
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	0	1092	0
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	130.265	1094	140.498
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	120.965	1095	131.198
1.1 Series no subordinadas	0096	95.247	1096	104.255
1.2 Series subordinadas	0097	51.800	1097	51.800
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	-26.081	1098	-24.858
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	9.300	1101	9.300
2.1 Préstamo subordinado	0102	5.269	1102	5.269
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	9.300	1103	9.300
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-5.269	1105	-5.269
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

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) PASIVO CORRIENTE	0117	20.386	1117	20.117
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	20.131	1123	20.006
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	20.103	1124	19.976
1.1 Series no subordinadas	0125	16.945	1125	17.601
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	-5.492	1127	-5.042
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	38	1128	63
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	8.613	1129	7.354
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	28	1131	30
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	-2.831	1135	-2.663
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	38	1136	40
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	2.822	1137	2.653
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	255	1148	110
1. Comisiones	0149	0	1149	1
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	0	1150	1
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
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	254	1157	110
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	150.652	1162	160.614

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	1.487	1201	1.507	2201	3.015	3201	2.466
1.1 Activos titulizados	0202	1.438	1202	1.461	2202	2.910	3202	2.392
1.2 Otros activos financieros	0203	48	1203	46	2203	105	3203	74
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-1.999	1204	-1.771	2204	-4.067	3204	-3.121
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.828	1205	-1.637	2205	-3.722	3205	-2.878
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-171	1206	-134	2206	-345	3206	-244
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	-512	1209	-264	2209	-1.052	3209	-655
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	1	1216	24	2216	2	3216	15
7. Otros gastos de explotación	0217	-233	1217	-221	2217	-524	3217	-447
7.1 Servicios exteriores	0218	-214	1218	-201	2218	-485	3218	-405
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-214	1219	-201	2219	-485	3219	-405
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
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	-19	1224	-20	2224	-39	3224	-42
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-15	1225	-15	2225	-31	3225	-31
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-4	1227	-4	2227	-8	3227	-8
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
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	0	3230	-3
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-20	1231	14	2231	-122	3231	-36
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-20	1232	14	2232	-122	3232	-36
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234	0	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	0	1236	0	2236	0	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	-114	1238	-40	2238	-147	3238	-49
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	878	1239	487	2239	1.842	3239	1.173
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

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	187	1300	444	2300	573	3300	450
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	206	1301	464	2301	610	3301	490
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.472	1302	1.422	2302	2.950	3302	2.303
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1.220	1303	-1.136	2303	-2.489	3303	-1.975
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	52	1306	42	2306	106	3306	66
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-90	1307	-65	2307	-179	3307	-107
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-9	1308	201	2308	221	3308	203
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-19	1309	-20	2309	-39	3309	-40
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-15	1310	-16	2310	-31	3310	-31
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-4	1312	-4	2312	-8	3312	-8
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	1	1315	0	2315	2	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	1	1321	0	2321	2	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	436	1322	17	2322	-295	3322	219
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
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	653	1325	241	2325	197	3325	659
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	1.986	1326	3.087	2326	4.134	3326	5.410
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	2.109	1327	3.080	2327	4.185	3327	6.052
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	822	1328	408	2328	1.150	3328	793
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	10	1329	14	2329	23	3329	26
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	155	1330	157	2330	370	3330	486
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-4.430	1331	-6.504	2331	-9.665	3331	-12.107
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-218	1332	-224	2332	-491	3332	-440
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	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-218	1336	-224	2336	-491	3336	-440
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	623	1337	461	2337	279	3337	669
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	3.019	1338	3.073	2338	3.363	3338	2.864
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	3.641	1339	3.534	2339	3.641	3339	3.534

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
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

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: BBVA, KUTXA BANK, CAIXABANK, CREDIFIMO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2024								Situación cierre anual anterior 31/12/2023								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	12,40	0400	17,72	0420	0,08	0440	6,01	1380	12,15	1400	16,60	1420	0,09	1440	6,82	2380	0,00	2400	0,00	2420	0,00	2440	12,00
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	29,71	0401	47,83	0421	0,05	0441	4,48	1381	29,15	1401	46,11	1421	0,12	1441	4,93	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	12,00
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		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: BBVA, KUTXA BANK, CAIXABANK, CREDIFIMO

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	148	0467	35	0474	16	0481	0	0488	51	0495	5.376	0502	0	0509	5.427
De 1 a 3 meses	0461	31	0468	23	0475	16	0482	0	0489	39	0496	2.022	0503	0	0510	2.061
De 3 a 6 meses	0462	11	0469	17	0476	4	0483	1	0490	22	0497	361	0504	0	0511	383
De 6 a 9 meses	0463	8	0470	15	0477	5	0484	6	0491	27	0498	376	0505	0	0512	403
De 9 a 12 meses	0464	4	0471	17	0478	3	0485	8	0492	28	0499	297	0506	0	0513	325
Más de 12 meses	0465	244	0472	6.384	0479	179	0486	4.194	0493	10.757	0500	11.510	0507	0	0514	22.268
Total	0466	446	0473	6.491	0480	224	0487	4.210	0494	10.925	0501	19.942	0508	0	1515	30.867

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	148	0522	35	0529	16	0536	0	0543	51	0550	5.376	0557	0	0564	5.427	0571	20.778	0578	20.778	0584	26,12
De 1 a 3 meses	0516	31	0523	23	0530	16	0537	0	0544	39	0551	2.022	0558	0	0565	2.061	0572	6.832	0579	6.832	0585	30,17
De 3 a 6 meses	0517	11	0524	17	0531	4	0538	1	0545	22	0552	361	0559	0	0566	383	0573	1.990	0580	1.990	0586	19,25
De 6 a 9 meses	0518	8	0525	15	0532	5	0539	6	0546	27	0553	376	0560	0	0567	403	0574	1.514	0581	1.514	0587	26,60
De 9 a 12 meses	0519	4	0526	17	0533	3	0540	8	0547	28	0554	297	0561	0	0568	325	0575	758	0582	758	0588	42,94
Más de 12 meses	0520	244	0527	6.384	0534	179	0541	4.194	0548	10.757	0555	11.510	0562	0	0569	22.268	0576	45.658	0583	45.658	0589	48,77
Total	0521	446	0528	6.491	0535	224	0542	4.210	0549	10.925	0556	19.942	0563	0	0570	30.867	0577	77.530			0590	39,81

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: BBVA, KUTXA BANK, CAIXABANK, CREDIFIMO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 19/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	668	1600	763	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	994	1601	1.110	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.097	1602	1.487	2602	236
Entre 3 y 4 años	0603	2.604	1603	1.774	2603	350
Entre 4 y 5 años	0604	3.191	1604	3.038	2604	873
Entre 5 y 10 años	0605	25.410	1605	23.564	2605	22.393
Superior a 10 años	0606	98.673	1606	111.163	2606	906.148
Total	0607	132.637	1607	142.899	2607	930.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	12,55	1608	12,85	2608	26,04

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 19/12/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	19,25	1609	18,76	2609	2,08

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: BBVA, KUTXA BANK, CAIXABANK, CREDIFIMO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 19/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	2.464	0630	82.778	1620	2.594	1630	87.918	2620	2.911	2630	139.563
40% - 60%	0621	447	0631	38.855	1621	493	1631	42.490	2621	2.154	2631	214.565
60% - 80%	0622	76	0632	10.148	1622	90	1632	11.635	2622	4.242	2632	510.176
80% - 100%	0623	7	0633	856	1623	7	1633	856	2623	518	2633	65.697
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	2.994	0638	132.637	1628	3.184	1638	142.899	2628	9.825	2638	930.000
Media ponderada (%)	0639	35,45	0649		1639	35,86	1649		2639	62,32	2649	

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: BBVA, KUTXA BANK, CAIXABANK, CREDIFIMO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 19/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	4,57	1650	3,75	2650	4,27
Tipo de interés nominal máximo	0651	7,71	1651	7,71	2651	6,55
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,44	1652	0,44	2652	2,70

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: BBVA, KUTXA BANK, CAIXABANK, CREDIFIMO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 19/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	1.195	0683	45.642	1660	1.266	1683	49.269	2660	4.380	2683	330.013
Aragón	0661	31	0684	877	1661	32	1684	947	2661	88	2684	8.408
Asturias	0662	1	0685	42	1662	1	1685	44	2662	1	2685	93
Baleares	0663	0	0686	0	1663	0	1686	0	2663	0	2686	0
Canarias	0664	33	0687	1.830	1664	33	1687	1.881	2664	94	2687	7.596
Cantabria	0665	36	0688	903	1665	38	1688	1.009	2665	84	2688	8.176
Castilla-León	0666	128	0689	3.860	1666	131	1689	4.163	2666	338	2689	33.484
Castilla La Mancha	0667	33	0690	1.402	1667	33	1690	1.446	2667	103	2690	9.933
Cataluña	0668	884	0691	49.889	1668	932	1691	52.714	2668	2.560	2691	301.591
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670	35	0693	1.620	1670	38	1693	1.854	2670	86	2693	7.667
Galicia	0671	2	0694	53	1671	2	1694	55	2671	3	2694	245
Madrid	0672	267	0695	14.635	1672	290	1695	16.000	2672	1.038	2695	108.340
Melilla	0673	1	0696	51	1673	1	1696	53	2673	3	2696	304
Murcia	0674	0	0697	0	1674	0	1697	0	2674	1	2697	57
Navarra	0675	2	0698	64	1675	2	1698	67	2675	7	2698	760
La Rioja	0676	32	0699	1.030	1676	37	1699	1.170	2676	100	2699	10.184
Comunidad Valenciana	0677	10	0700	945	1677	12	1700	1.050	2677	37	2700	3.323
País Vasco	0678	304	0701	9.793	1678	336	1701	11.175	2678	902	2701	99.824
Total España	0679	2.994	0702	132.637	1679	3.184	1702	142.899	2679	9.825	2702	930.000
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	2.994	0705	132.637	1682	3.184	1705	142.899	2682	9.825	2705	930.000

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: BBVA, KUTXA BANK, CAIXABANK, CREDIFIMO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 19/12/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,64			1710	1,53			2710	0,45		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2024			Situación cierre anual anterior 31/12/2023			Situación inicial 19/12/2006					
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			
ES0377954005	SERIE A1	3.023	0	0	3.023	0	0	3.023	100.000	302.300			
ES0377954013	SERIE A2	3.952	0	0	3.952	0	0	3.952	100.000	395.200			
ES0377954021	SERIE A3	1.813	61.882	112.192	1.813	67.213	121.857	1.813	100.000	181.300			
ES0377954039	SERIE B	139	100.000	13.900	139	100.000	13.900	139	100.000	13.900			
ES0377954047	SERIE C	93	100.000	9.300	93	100.000	9.300	93	100.000	9.300			
ES0377954054	SERIE D	140	100.000	14.000	140	100.000	14.000	140	100.000	14.000			
ES0377954062	SERIE E	140	100.000	14.000	140	100.000	14.000	140	100.000	14.000			
ES0377954070	SERIE F	6	100.000	600	6	100.000	600	6	100.000	600			
ES0377954088	NAS/IO	1.813	0	0	1.813	0	0	1.813	2.624	4.758			
Total		0723	11.119	0724	163.992	1723	11.119	1724	173.657	2723	11.119	2724	935.358

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2024

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		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado	0738	0739				
						0730	0731		0732	0733				0734	0735	0742	0736
ES0377954005	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0				
ES0377954013	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0				
ES0377954021	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	3,91	24	0	NO	112.192	0	112.216	0	0				
ES0377954039	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,20	3,92	3	815	NO	13.900	0	14.718	0	0				
ES0377954047	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,31	4,03	2	665	NO	9.300	0	9.967	0	0				
ES0377954054	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,51	4,23	3	1.646	NO	14.000	0	15.649	-11.481	-11.481				
ES0377954062	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,15	5,87	5	5.109	NO	14.000	0	19.113	-19.113	-19.113				
ES0377954070	SERIE F	S	EURIBOR 3 m	3,00	6,72	0	379	NO	600	0	979	-979	-979				
ES0377954088	NAS/IO	NS	2,5% del SNP Bono A3	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0				
Total						0740	38	0741	8.613	0743	163.992	0744	0	0745	172.642	0746	-31.574

	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 19/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	4,24	0748	3,68	0749	3,91

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2024								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2023							
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								
ES0377954005	SERIE A1	0	302.300	0	20.485	0	302.300	0	20.485	0	302.300	0	20.485	0	302.300	0	20.485
ES0377954013	SERIE A2	0	395.200	0	58.360	0	395.200	0	58.360	0	395.200	0	58.360	0	395.200	0	58.360
ES0377954021	SERIE A3	4.430	69.108	1.220	36.458	6.504	49.519	1.136	31.383	4.430	69.108	1.220	36.458	6.504	49.519	1.136	31.383
ES0377954039	SERIE B	0	0	0	2.228	0	0	0	2.228	0	0	0	0	0	0	0	2.228
ES0377954047	SERIE C	0	0	0	1.490	0	0	0	1.490	0	0	0	0	0	0	0	1.490
ES0377954054	SERIE D	0	0	0	2.031	0	0	0	2.031	0	0	0	0	0	0	0	2.031
ES0377954062	SERIE E	0	0	0	2.641	0	0	0	2.641	0	0	0	0	0	0	0	2.641
ES0377954070	SERIE F	0	0	0	44	0	0	0	44	0	0	0	0	0	0	0	44
ES0377954088	NAS/IO	0	4.758	0	302	0	4.758	0	302	0	4.758	0	302	0	4.758	0	302
Total		0754	4.430	0755	771.366	0756	1.220	0757	124.039	1754	6.504	1755	751.777	1756	1.136	1757	118.964

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2024

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 30/06/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 19/12/2006
				0760	0761	0762
ES0377954005	SERIE A1	20/12/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0377954005	SERIE A1	20/12/2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0377954013	SERIE A2	27/05/2020	FCH	CCC	CCC	AAA
ES0377954013	SERIE A2	26/10/2012	SYP	NR	NR	AAA
ES0377954021	SERIE A3	16/10/2014	FCH	CCC	CCC	AAA
ES0377954021	SERIE A3	26/10/2012	SYP	NR	NR	AAA
ES0377954039	SERIE B	27/05/2020	FCH	C	C	AA
ES0377954039	SERIE B	26/10/2012	SYP	NR	NR	AA
ES0377954047	SERIE C	22/01/2018	FCH	C	C	A
ES0377954047	SERIE C	26/10/2012	SYP	NR	NR	A
ES0377954054	SERIE D	22/01/2018	FCH	C	C	BBB
ES0377954054	SERIE D	26/10/2012	SYP	NR	NR	BBB-
ES0377954062	SERIE E	27/09/2016	FCH	C	C	BB
ES0377954062	SERIE E	26/10/2012	SYP	NR	NR	BB-
ES0377954070	SERIE F	27/09/2016	FCH	C	C	B+
ES0377954070	SERIE F	26/10/2012	SYP	NR	NR	B
ES0377954088	NAS/IO	20/12/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0377954088	NAS/IO	20/12/2006	SYP	AAA	AAA	AAA

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2024

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 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 19/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	22.503	1765	10.345	2765	38.661
Entre 1 y 2 años	0766	18.678	1766	10.183	2766	26.316
Entre 2 y 3 años	0767	15.451	1767	9.992	2767	26.864
Entre 3 y 4 años	0768	12.762	1768	9.884	2768	26.833
Entre 4 y 5 años	0769	94.597	1769	9.655	2769	27.880
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	123.599	2770	151.100
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	637.704
Total	0772	163.992	1772	173.657	2772	935.358
Vida residual media ponderada (años)	0773	4,75	1773	9,50	2773	19,79

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 19/12/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	0	1775	0	2775	9.300
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	9.300	1776	9.300	2776	9.300
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	0,00	1777	0,00	2777	0,99
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Ver Nota S.06	1778	Ver Nota S.06	2778	Ver Nota S.06
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		1781		2781	9.300
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	0,99
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	Ver Nota S.06
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		1786		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	65,00	1792	67,32	2792	94,46
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	

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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 30/06/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 19/12/2006			
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806		
Total						0808		0809		0810	

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 19/12/2006		Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 19/12/2006			
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	

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	739	7006	463	7009	0,66	7012	0,38	7015	0,59		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	739	7008	463	7011	0,66	7014	0,38	7017	0,59	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	53.480	7024	55.893	7027	32,39	7030	31,68	7033	32,20		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	137	7025	137	7028	0,08	7031	0,08	7034	0,08		
Total Fallidos					7023	53.616	7026	56.029	7029	32,47	7032	31,75	7035	32,28	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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
SERIE D - ES0377954054	11,01	31,34	30,51	4.9.2.1.3.
SERIE B - ES0377954039	3,00	17,58	17,50	4.9.2.1.3.
SERIE D - ES0377954054	10,00	19,93	20,17	4.9.2.1.3.
SERIE E - ES0377954062	3,00	17,58	17,50	4.9.2.1.3.
SERIE C - ES0377954047	1,50	0,66	0,59	4.9.2.1.3.
SERIE E - ES0377954062	11,01	31,34	30,51	4.9.2.1.3.
SERIE E - ES0377954062	10,00	19,93	20,17	4.9.2.1.3.
SERIE E - ES0377954062	1,50	0,66	0,59	4.9.2.1.3.
SERIE C - ES0377954047	3,00	17,58	17,50	4.9.2.1.3.
SERIE B - ES0377954039	1,50	0,66	0,59	4.9.2.1.3.
SERIE D - ES0377954054	3,00	17,58	17,50	4.9.2.1.3.
SERIE A1 - ES0377954005	6,00	0,66	0,59	4.9.2.1.2.
SERIE B - ES0377954039	11,01	31,34	30,51	4.9.2.1.3.
SERIE A3 - ES0377954021	6,00	0,66	0,59	4.9.2.1.2.
SERIE D - ES0377954054	1,50	0,66	0,59	4.9.2.1.3.
SERIE A2 - ES0377954013	6,00	0,66	0,59	4.9.2.1.2.
SERIE C - ES0377954047	10,00	19,93	20,17	4.9.2.1.3.
SERIE C - ES0377954047	11,01	31,34	30,51	4.9.2.1.3.
SERIE B - ES0377954039	10,00	19,93	20,17	4.9.2.1.3.
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0377954039	11,40	11,72	11,71	3.4.6.2
SERIE E - ES0377954062	4,20	11,72	11,71	3.4.6.2
SERIE D - ES0377954054	5,50	11,72	11,71	3.4.6.2
SERIE C - ES0377954047	8,60	11,72	11,71	3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		0,00	0,00	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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 las Participaciones y de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,019	4862		5862	14	6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, S.E.	1864	3	2864	Saldo Nominal pendiente de vencimiento de las Participaciones y los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3864	0,003	4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Multicedente
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.6.4

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															

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)	Fecha cálculo										Total	
	0885	28/03/2024	28/06/2024									
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885											
Saldo inicial	0886	901	901									
Cobros del periodo	0887	6.888	6.003									
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-279	-264									
Pagos por derivados	0889	0	0									
Retención importe Fondo de Reserva	0890	0	0									
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-6.504	-5.650									
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0									
Resto pagos/retenciones	0893	-105	-90									
Saldo disponible	0894	901	901									
Liquidación de comisión variable	0895	0	0									0

Denominación Fondo: TDA 27, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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