

TDA 28 - Fondo de Titulización de Activos (en proceso de liquidación)

LIQUIDACION DEL PERIODO 28/10/19 - 28/01/20

	Euros
	TOTAL
I. Situación inicial	3.406.477,96
Fondo de Reserva	0,00
Cantidad Dotada Línea Líquidez a 28/10/19	1.477.912,96
Saldo Inicial Cuenta Tesorería	1.928.565,00
II. Fondos recibidos del emisor	3.879.819,91
Principal:	
Según calendario hasta 31/12/19:	1.678.773,04
Amort. Anticipada hasta 31/12/19:	1.233.647,88
Intereses:	422.898,99
Venta de Inmuebles	544.500,00
III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):	7.286.297,87
IV. Total intereses de la reinversión:	-8.850,34
Intereses de la Cta. De Tesorería	-3.793,00
Intereses de la Cta. De Cobros	-2.660,34
Intereses de la Cta. De Amortización Línea Líquidez	-2.397,00
V. Recursos disponibles (III + IV):	7.277.447,53
VI. Gastos	416.979,62
VII. Pago liquidativo swap:	-6.860.467,91
VIII. Línea Líquidez	0,00
Intereses	0,00
Amortización	0,00
IX. Pago a los Bonos:	0,00
Bonos A:	
Intereses correspondientes al 28/01/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización teórica correspondiente al 28/01/20:	0,00
Bonos B:	
Intereses debidos anterior fecha de pago	573.316,38
Intereses vencidos al 28/01/20:	0,00
Intereses pagados al 28/01/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados actuales	573.316,38
Amortización correspondiente al 28/01/20:	0,00
Bonos C:	
Intereses debidos anterior fecha de pago	568.056,60
Intereses vencidos al 28/01/20:	368,10
Intereses pagados al 28/01/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados actuales	568.424,70
Amortización correspondiente al 28/01/20:	0,00
Bonos D:	
Intereses debidos anterior fecha de pago	784.838,16
Intereses vencidos al 28/01/20:	7.286,40
Intereses pagados al 28/01/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados actuales	792.124,56
Amortización correspondiente al 28/01/20:	0,00
Bonos E:	
Intereses debidos anterior fecha de pago	2.736.226,17
Intereses vencidos al 28/01/20:	53.737,02
Intereses pagados al 28/01/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados actuales	2.789.963,19
Amortización correspondiente al 28/01/20:	0,00
Bonos F:	
Intereses debidos anterior fecha de pago	1.082.523,15
Intereses vencidos al 28/01/20:	21.031,11
Intereses pagados al 28/01/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados actuales	1.103.554,26
Amortización correspondiente al 28/01/20:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	0,00
X. Saldo disponible:	0,00
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva (28/10/19)	0,00
Aportación al Fondo de Reserva	0,00
Intereses préstamo subordinado G.I. pagados	0,00
Amortización préstamo subordinado G.I.	0,00
Otros Recursos (dif. Bonos - PHs)	0,00
Margen de Intermediación Financiera	0,00
Fondo de Reserva 28/01/20:	0,00
Cantidad Dotada Línea Líquidez a 28/10/19	1.477.912,96
Cantidad Dotada Línea Líquidez a 28/01/20	0,00

Destinatarios: CNMV, AIAF



Nº: 230/20

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

http://www.tda-sgft.com

TDA28liq.trimEne20

TDA 28 (en proceso de liquidación)

Fondo de Titulización de Activos

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 28 de Enero de 2020

		Importes en euros	
I. BONOS A ES0377930005	Sobre 4140 bonos	Por Bono	
1. Saldo inicial (23/07/2007):	414.000.000,00 €	100.000,00 €	
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	199.375.858,80 €	48.158,42 €	
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	199.375.858,80 €	48.158,42 €	
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	48,158420%	48,158420%	
II. BONOS B ES0377930013	Sobre 117 bonos	Por Bono	
1. Saldo inicial (23/07/2007):	11.700.000,00 €	100.000,00 €	
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	11.700.000,00 €	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:	573.316,38 €	4.900,14 €	
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	11.700.000,00 €	100.000,00 €	
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%	
III. BONOS C ES0377930021	Sobre 90 bonos	Por Bono	
1. Saldo inicial (23/07/2007):	9.000.000,00 €	100.000,00 €	
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	9.000.000,00 €	100.000,00 €	
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	368,10 €	4,09 €	
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	568.424,70 €	6.315,83 €	
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	9.000.000,00 €	100.000,00 €	
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%	
IV. BONOS D ES0377930039	Sobre 72 bonos	Por Bono	
1. Saldo inicial (23/07/2007):	7.200.000,00 €	100.000,00 €	
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	7.200.000,00 €	100.000,00 €	
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	7.286,40 €	101,20 €	
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	792.124,56 €	11.001,73 €	
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	7.200.000,00 €	100.000,00 €	
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%	
V. BONOS E ES0377930047	Sobre 81 bonos	Por Bono	
1. Saldo inicial (23/07/2007):	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:	53.737,02 €	663,42 €	
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	2.789.963,19 €	34.443,99 €	
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%	
VI. BONOS F ES0377930054	Sobre 27 bonos	Por Bono	
1. Saldo inicial (23/07/2007):	1.350.000,00 €	50.000,00 €	
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	1.350.000,00 €	50.000,00 €	
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	21.031,11 €	778,93 €	
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	1.103.554,26 €	40.872,38 €	
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €	
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	1.350.000,00 €	50.000,00 €	
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%	

VII. EL FONDO		Importes en euros	
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/12/19:			
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:		128.231.400,83 €	
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:		69.673.267,43 €	
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:		128.266.418,28 €	
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:		102.233.732,82 €	
2. Amortización del período 30/09/19 a 31/12/19:			
a) Según calendario:		1.678.773,04 €	
b) Amortización anticipada hasta 31/12/19:		1.233.647,88 €	
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):			
b) Ultimo año:		2,87%	
c) Ultimo semestre:		3,11%	
d) Ultimo trimestre:		3,71%	
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:			
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:			
6. Porcentaje de fallidos (1):			
7. Porcentaje de préstamos con impago superior a 90 días (2):			

(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 no fallidas con morosidad superior a 90 días el último día del mes anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

Destinatarios: Cedentes; CNMV; AIAF



Nº: 231/20

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.: 917020808
<http://www.tda-sgft.com>
TDA28Infoinver.trimEne20

TDA 28 , FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS (en proceso de liquidación)

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 28/10/19-28/01/20

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO	
Fecha de Constitución del Fondo	18 de julio de 2007
Fecha Emisión BTH	18 de julio de 2007
Fecha Final Amortización BTH (2,87% TAA)	29 de julio de 2030
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca	BBVA (Caixa Terrassa) Credifimo
Agente de Pagos	BNP PARIBAS
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Fitch Ibca
Calificación	Bonos A: (F) CC (sf) Bonos B: (F) C (sf) Bonos C: (F) C (sf) Bonos D: (F) C (sf) Bonos E: (F) C (sf) Bonos F: (F) C (sf)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO	
Nombre	Bonos de Titulización TDA 28, F.T.A. (en proceso de liquidación)
Serie A:	
Código ISIN	ES0377930005
Nominal en circulación total (inicial)	414.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	199.375.858,80 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	48.158,42 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0377930013
Nominal en circulación total (inicial)	11.700.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	11.700.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)	
Nombre	Bonos de Titulización TDA 28, F.T.A. (en proceso de liquidación)
Serie C:	
Código ISIN	ES0377930021
Nominal en circulación total (inicial)	9.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	9.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie D:	
Código ISIN	ES0377930039
Nominal en circulación total (inicial)	7.200.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	7.200.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie E:	
Código ISIN	ES0377930047
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 F:	
Código ISIN	ES0377930054
Nominal en circulación total (inicial)	1.350.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	1.350.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	50.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	50.000,00 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA
* Liquidación del Período:28/10/19-28/01/20
* Flujos de Caja del Período:28/10/19-28/01/20
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 28 de Enero de 2020

TDA 28 (en proceso de liquidación)**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 28/10/19 - 28/01/20**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip.		0,00
Amortización Participaciones Hip.	2.912.420,92	
Venta de Inmueble	544.500,00	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
II. INTERESES		
Intereses pagados línea de liquidez		0,00
Intereses pagados a los BTH		0,00
Intereses recibidos de las PHs	422.898,99	
Intereses Inversiones Temporales	-8.850,34	
Intereses Ptmos. Subordinados		0,00
III. GASTOS		7.277.447,53
Comisiones y Gastos		416.979,62
Pago liquidativo swap		6.860.467,91
Margen de Intermediación Financiera		0,00
Total Ingresos/Pagos	3.870.969,57	7.277.447,53
Saldo inicial 28/10/19		
A Inversiones Temporales		0,00
Recursos pendientes de aplicación	3.406.477,96	0,00
Otros Recursos		0,00
Total	7.277.447,53	7.277.447,53
Retenciones practicadas el 28/01/20	0,00	
A Inversiones Temporales		0,00

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 238/20**

Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

TDA28\fluj.trim\Ene20