

| TDA 27 - Fondo de Titulización de Activos (en proceso de liquidación) | |
|---|--------------|
| LIQUIDACION DEL PERIODO 30/06/25 - 29/09/25 | |
| | Euros |
| | TOTAL |
| | |
| I. Situación inicial | 11,06 |
| Fondo de Reserva | 0,00 |
| Saldo Inicial Cuenta Tesorería | 11,06 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 5.019.405,25 |
| Principal: | |
| Según calendario hasta 31/08/25: | 2.332.319,93 |
| Amort. Anticipada hasta 31/08/25: | 1.701.761,03 |
| Intereses: | 842.229,71 |
| Ingresos por inmuebles: | 143.094,58 |
| III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II): | 5.019.416,31 |
| | |
| IV. Total intereses de la reinversión: | 20.594,86 |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | 9.535,95 |
| Intereses de la Cta. De Cobros | 7.750,15 |
| Intereses de la Cta. De Amortización Línea Liquidez | 3.308,76 |
| V. Disposición Línea Liquidez en Fecha de Pago actual | 0,00 |
| | |
| VI. Recursos disponibles (III + IV + V): | 5.040.011,17 |
| | |
| VII. Varios: | 192.149,76 |
| | |
| VIII. Línea Liquidez | 44.288,40 |
| Intereses | 44.288,40 |
| Amortización | 0,00 |
| IX. Pago a los Bonos: | 4.803.570,92 |
| Bonos A3: | |
| Intereses correspondientes al 29/09/25: | 506.742,79 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -96.281,13 |
| Amortización correspondiente al 29/09/25: | 4.296.828,13 |
| Bonos B: | |
| Intereses vencidos al 29/09/25: | 76.596,72 |
| Intereses pagados al 29/09/25: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Intereses impagados al 29/09/25: | 1.350.289,08 |
| Amortización correspondiente al 29/09/25: | 0,00 |
| Bonos C: | |
| Intereses vencidos al 29/09/25: | 53.834,08 |
| Intereses pagados al 29/09/25: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Intereses impagados al 29/09/25: | 1.036.580,58 |
| Amortización correspondiente al 29/09/25: | 0,00 |
| Bonos D: | |
| Intereses vencidos al 29/09/25: | 88.118,33 |
| Intereses pagados al 29/09/25: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Intereses impagados al 29/09/25: | 2.240.492,17 |
| Amortización correspondiente al 29/09/25: | 0,00 |
| Bonos E: | |
| Intereses vencidos al 29/09/25: | 146.156,11 |
| Intereses pagados al 29/09/25: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Intereses impagados al 29/09/25: | 5.995.595,66 |
| Amortización correspondiente al 29/09/25: | 0,00 |
| Bonos F: | |
| Intereses vencidos al 29/09/25: | 7.552,99 |
| Intereses pagados al 29/09/25: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Intereses impagados al 29/09/25: | 423.246,88 |
| Amortización correspondiente al 29/09/25: | 0,00 |
| Reinversión o devolución de las retenciones: | 96.281,13 |
| | |
| X. Saldo disponible (VI - VII - VIII - IX): | 2,09 |
| | |
| Distribución del saldo disponible: | |
| | |
| Fondo de Reserva (30/06/25) | 0,00 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 0,00 |
| Dotación Amortización Línea Liquidez | 0,00 |
| Intereses préstamo subordinado G.I. pagados | 0,00 |
| Amortización préstamo subordinado G.I. | 0,00 |
| Intereses préstamo participativo | 0,00 |
| Amortización préstamo participativo | 0,00 |
| Otros Recursos para el siguiente pago | 2,09 |
| Margen de Intermediación Financiera | 0,00 |
| | |
| Fondo de Reserva 29/09/25: | 0,00 |
| | |
| Cantidad Dotada Línea Liquidez a 30/06/25 | 900.884,40 |
| Cantidad Dotada Línea Liquidez a 29/09/25 | 900.884,40 |

Destinatarios: CNMV; AIAF

TDA 27 (en proceso de liquidación)

Fondo de Titulización de Activos

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 29 de Septiembre de 2025

| | | |
|---|-------------------|-----------------|
| Importes en euros | | |
| I. BONOS A3 ES0377954021 | Sobre 1813 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/12/2006): | 181.300.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 92.382.339,63 € | 50.955,51 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 506.742,79 € | 279,5051 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 4.296.828,13 € | 2.370,01 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 88.085.511,50 € | 48.585,50 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 48,585500% | 48,585500% |
| II. BONOS B ES0377954039 | Sobre 139 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/12/2006): | 13.900.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 13.900.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses debidos en la anterior fecha de pago: | 1.273.692,36 € | 9.163,2544 € |
| 4. Intereses devengados en esta Fecha de Pago: | 76.596,72 € | 551,0556 € |
| 5. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,0000 € |
| 6. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago: | 1.350.289,08 € | 9.714,3100 € |
| 7. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 8. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 13.900.000,00 € | 100.000,00 € |
| 9. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| III. BONOS C ES0377954047 | Sobre 93 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/12/2006): | 9.300.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 9.300.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses debidos en la anterior fecha de pago: | 982.746,50 € | 10.567,1667 € |
| 4. Intereses devengados en esta Fecha de Pago: | 53.834,08 € | 578,8611 € |
| 5. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,0000 € |
| 6. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago: | 1.036.580,58 € | 11.146,0278 € |
| 7. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 8. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 9.300.000,00 € | 100.000,00 € |
| 9. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| IV. BONOS D ES0377954054 | Sobre 140 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/12/2006): | 14.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 14.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses debidos en la anterior fecha de pago: | 2.152.373,84 € | 15.374,0989 € |
| 4. Intereses devengados en esta Fecha de Pago: | 88.118,33 € | 629,4167 € |
| 5. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,0000 € |
| 6. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago: | 2.240.492,17 € | 16.003,5156 € |
| 7. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 8. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 14.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 9. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| V. BONOS E ES0377954062 | Sobre 140 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/12/2006): | 14.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 14.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses debidos en la anterior fecha de pago: | 5.849.439,55 € | 41.781,7111 € |
| 4. Intereses devengados en esta Fecha de Pago: | 146.156,11 € | 1.043,9722 € |
| 5. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,0000 € |
| 6. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago: | 5.995.595,66 € | 42.825,6833 € |
| 7. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 8. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 14.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 9. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| VI. BONOS F ES0377954070 | Sobre 6 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/12/2006): | 600.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 600.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses debidos en la anterior fecha de pago: | 415.693,89 € | 69.282,3156 € |
| 4. Intereses devengados en esta Fecha de Pago: | 7.552,99 € | 1.258,8333 € |
| 5. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,0000 € |
| 6. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago: | 423.246,88 € | 70.541,1489 € |
| 7. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 8. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 600.000,00 € | 100.000,00 € |
| 9. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| VII. EL FONDO | Importes en euros | |
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/08/25: | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas: | | 91.478.558,79 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas: | | 39.708.546,62 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas : | | 91.542.729,29 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidas: | | 72.127.238,39 € |
| 2. Amortización del período 31/05/25 a 31/08/25: | 4.034.080,96 € | |
| a) Según calendario: | | 2.332.319,93 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/08/25: | | 1.701.761,03 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | |
| a) Ultimo año: | | 7,21% |
| b) Ultimo semestre: | | 7,84% |
| c) Ultimo trimestre: | | 6,94% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | | 0,67% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses: | | 0,08% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | | 44,07% |
| 7. Nivel de Impago (2) | | 0,22% |

(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.

TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS (en proceso de liquidación)

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 30/06/25 - 29/09/25

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|---|---|
| Fecha de Constitución del Fondo | 20 de diciembre de 2006 |
| Fecha Emisión Bonos | 20 de diciembre de 2006 |
| Fecha Final Amortización Bonos (7,21% TAA) | 28 de diciembre de 2028 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca | Bankia (Caja Granada), Caixabank (Credifimo) BBVA (Caixa Terrasa), Kutxa Bank (Caja Vital) |
| Agente de Pagos | BNP PARIBAS |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Fitch Ratings, Standard & Poor's |
| Calificación | Bono A3: (F) CCC (sf) / (S&P) NR Bono B: (F) C (sf) / (S&P) NR Bono C: (F) C (sf) / (S&P) NR Bono D: (F) C (sf) / (S&P) NR Bono E: (F) C (sf) / (S&P) NR Bono F: (F) C (sf) / (S&P) NR |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Nombre | Bonos de Titulización TDA 27 |
|---|------------------------------|
| Serie A3: | |
| Código ISIN | ES0377954021 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 181,300.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 88.085.511,50 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 48.585,50 Euros |

| II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.) | |
|---|------------------------------|
| Nombre | Bonos de Titulización TDA 27 |
| Serie B: | |
| Código ISIN | ES0377954039 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 13.900.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 13.900.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie C: | |
| Código ISIN | ES0377954047 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 9.300.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 9.300.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie D: | |
| Código ISIN | ES0377954054 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 14.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 14.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie E: | |
| Código ISIN | ES0377954062 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 14.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 14.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie F: | |
| Código ISIN | ES0377954070 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 600.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 600.000,00 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: 30/06/25 - 29/09/25 |
| * Flujos de Caja del Período: 30/06/25 - 29/09/25 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 29 de Septiembre de 2025 |

TDA 27 (en proceso de liquidación)**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 30/06/25 - 29/09/25**

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | Euros | |
|---|---------------------|---------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 4.296.828,13 |
| Amortización Participaciones Hip. | 4.034.080,96 | |
| Amortización Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| Ingresos por Inmuebles | 143.094,58 | |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados línea de liquidez | | 44.288,40 |
| Intereses pagados a los BTH | | 506.742,79 |
| Intereses recibidos de las PHs | 842.229,71 | |
| Intereses Inversiones Temporales | 20.594,86 | |
| Intereses Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| III. DISPOSICIÓN LÍNEA DE LIQUIDEZ | 0,00 | |
| IV. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: | | 192.149,76 |
| Margen de Intermediación Financiera | | 0,00 |
| Total Ingresos/Pagos | 5.040.000,11 | 5.040.009,08 |
| Saldo inicial 30/06/25 | 11,06 | |
| A Inversiones Temporales | | 2,09 |
| Total | 5.040.011,17 | 5.040.011,17 |
| Retenciones practicadas el 29/09/25 | 96.281,13 | |
| A Inv.Temporales | | 96.281,13 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 2897/25**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA 27\fluj.trim\Sep25