

TDA 27 - Fondo de Titulización de Activos (en proceso de liquidación)	
LIQUIDACION DEL PERIODO 29/09/25 - 29/12/25	
	Euros TOTAL
I. Situación inicial	2,09
Fondo de Reserva	0,00
Saldo Inicial Cuenta Tesorería	2,09
II. Fondos recibidos del emisor	5.471.357,29
Principal:	
Según calendario hasta 30/11/25:	3.021.805,38
Amort. Anticipada hasta 30/11/25:	1.454.202,39
Intereses:	787.557,08
Ingresos por inmuebles:	207.792,44
III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):	5.471.359,38
IV. Total intereses de la reinversión:	17.410,94
Intereses de la Cta. De Tesorería	7.785,02
Intereses de la Cta. De Cobros	6.414,46
Intereses de la Cta. De Amortización Linea Liquidez	3.211,46
V. Disposición Línea Liquidez en Fecha de Pago actual	0,00
VI. Recursos disponibles (III + IV + V):	5.488.770,32
VII. Varios:	245.366,08
VIII. Línea Liquidez	43.126,52
Intereses	43.126,52
Amortización	0,00
IX. Pago a los Bonos:	5.200.273,15
Bonos A3:	
Intereses correspondientes al 29/12/25:	483.173,49
Retenciones practicadas a los bonos:	-91.802,96
Amortización correspondiente al 29/12/25:	4.717.099,66
Bonos B:	
Intereses vencidos al 29/12/25:	76.596,72
Intereses pagados al 29/12/25:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados al 29/12/25:	1.426.885,80
Amortización correspondiente al 29/12/25:	0,00
Bonos C:	
Intereses vencidos al 29/12/25:	53.834,08
Intereses pagados al 29/12/25:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados al 29/12/25:	1.090.414,66
Amortización correspondiente al 29/12/25:	0,00
Bonos D:	
Intereses vencidos al 29/12/25:	88.118,33
Intereses pagados al 29/12/25:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados al 29/12/25:	2.328.610,50
Amortización correspondiente al 29/12/25:	0,00
Bonos E:	
Intereses vencidos al 29/12/25:	146.156,11
Intereses pagados al 29/12/25:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados al 29/12/25:	6.141.751,77
Amortización correspondiente al 29/12/25:	0,00
Bonos F:	
Intereses vencidos al 29/12/25:	7.552,99
Intereses pagados al 29/12/25:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados al 29/12/25:	430.799,87
Amortización correspondiente al 29/12/25:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	91.802,96
X. Saldo disponible (VI - VII - VIII - IX):	4,57
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva (29/09/25)	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	4,57
Margen de Intermediación Financiera	0,00
Fondo de Reserva 29/12/25:	0,00
Cantidad Dotada Línea Líquidez a 29/09/25	900.884,40
Cantidad Dotada Línea Líquidez a 29/12/25	900.884,40

Destinatarios: CNMV; AIAF



Nº: 3887/25

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA27\liq.trim\Dic25

TDA 27 (en proceso de liquidación)
Fondo de Titulización de Activos
INFORMACION A LOS INVERSORES
FECHA DE PAGO: 29 de Diciembre 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:	88.085.511,50 €	48.585,50 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	483.173,49 €	266.5050 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	4.717.099,66 €	2.601,82 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	83.368.411,84 €	45.983,68 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	45,983680%	45,983680%
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:	1.350.289,08 €	9.714,3100 €
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:	1.426.885,80 €	10.265,3656 €
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:	1.036.580,58 €	11.146,0278 €
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:	1.090.414,66 €	11.724,8889 €
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:	2.240.492,17 €	16.003,5156 €
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:	2.328.610,50 €	16.632,9322 €
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:	5.995.595,66 €	42.825,6833 €
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:	6.141.751,77 €	43.869,6556 €
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:	423.246,88 €	70.541,1489 €
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:	430.799,87 €	71.799,9822 €
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 30/11/25:		
a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas:		87.799.732,63 €
b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas:		12.782.309,87 €
c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas :		87.852.654,29 €
d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas:		19.330.521,52 €
e) Deuda pendiente de capital de los activos adjudicados, con o sin garantía:		51.804.554,73 €
2. Amortización del periodo 31/08/25 a 30/11/25:		4.476.007,77 €
a) Según calendario:		3.021.805,38 €
b) Amortización anticipada hasta 30/11/25:		1.454.202,39 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):		
a) Ultimo año:		7,21%
b) Ultimo semestre:		6,50%
c) Ultimo trimestre:		6,21%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:		0,59%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:		0,05%
6. Porcentaje de fallidos (1):		44,74%
7. Nivel de Impago (2)		0,25%

(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: 388825
 Titulización de Activos, (SGFT), S.A.
 Orense, 58
 28020 Madrid
 Tel. 917020808
<http://www.tda-sgft.com>
 TDA27|InfoInver.trim|Dic25

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

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 29/09/25 - 29/12/25

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)	83.368.411,84 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	45.983,68 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: 29/09/25 - 29/12/25

* Flujos de Caja del Período: 29/09/25 - 29/12/25

* Información a los inversores. Fecha de Pago: 29 de Diciembre de 2025

TDA 27 (en proceso de liquidación)

Fondo de Titulización de Activos

FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 29/09/25 - 29/12/25

	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
I. INVERSIONES/FINANCIACIONES		
Amortización Bonos Titulización Hip.		4.717.099,66
Amortización Participaciones Hip.	4.476.007,77	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
Ingresos por Inmuebles	207.792,44	
II. INTERESES		
Intereses pagados línea de liquidez		43.126,52
Intereses pagados a los BTH		483.173,49
Intereses recibidos de las PHs	787.557,08	
Intereses Inversiones Temporales	17.410,94	
Intereses Ptmos. Subordinados		0,00
III. DISPOSICIÓN LÍNEA DE LIQUIDEZ	0,00	
IV. GASTOS		
Comisiones Periódicas:		245.366,08
Margen de Intermediación Financiera		0,00
Total Ingresos/Pagos	5.488.768,23	5.488.765,75
Saldo inicial 29/09/25	2,09	
A Inversiones Temporales		4,57
Total	5.488.770,32	5.488.770,32
Retenciones practicadas el 29/12/25	91.802,96	
A Inv.Temporales		91.802,96

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 3894/25

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA 27\fluj.trim\Dic25