

TDA 29 - FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS

LIQUIDACION DEL PERIODO 29/05/2023-28/08/2023

Esta liquidación sustituye a la anterior nº 3050/23

| | BANCA MARCH | SABADELL (GUIPUZCOANO) | TOTAL |
|--|---------------------|------------------------|----------------------|
| I. Situación al 29/05/23: | 2.100.000,00 | 2.800.000,00 | 4.900.000,00 |
| Fondo de Reserva | 2.100.000,00 | 2.800.000,00 | 4.900.000,00 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 3.880.893,30 | 3.279.007,40 | 7.159.900,70 |
| Principal: | 3.173.013,82 | 2.848.022,56 | 6.021.036,38 |
| Según calendario hasta 31/07/23: | 1.278.765,96 | 1.365.357,91 | 2.644.123,87 |
| Amort. Anticipada hasta 31/07/23: | 1.894.247,86 | 1.482.664,65 | 3.376.912,51 |
| Intereses: | 707.879,48 | 430.984,84 | 1.138.864,32 |
| III. Subtotal a Cuenta de reinversión (I + II): | 5.980.893,30 | 6.079.007,40 | 12.059.900,70 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | 37.135,28 | 45.242,14 | 82.377,42 |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | 948,73 | 939,59 | 1.888,32 |
| Intereses de la Cta. De Reinversión | 36.186,55 | 44.302,55 | 80.489,10 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 6.018.028,58 | 6.124.249,54 | 12.142.278,12 |
| VI. Gastos: | 22.412,76 | 16.937,26 | 39.350,02 |
| VII. Liquidación del Swap | 193.427,85 | 155.531,66 | 348.959,51 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo): | 707.879,48 | 430.984,84 | 1.138.864,32 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (HSBC): | 901.307,33 | 586.516,50 | 1.487.823,83 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 3.981.919,98 | 3.213.794,05 | 7.195.714,03 |
| Bonos A2: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/08/23: | 707.282,90 | 460.257,10 | 1.167.540,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 134.383,75 | 87.448,85 | 221.832,60 |
| Amortización correspondiente al 28/08/23: | 2.879.020,44 | 2.417.670,06 | 5.296.690,50 |
| Bonos B: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/08/23: | 48.773,01 | 31.738,53 | 80.511,54 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 9.266,87 | 6.030,32 | 15.297,19 |
| Amortización correspondiente al 28/08/23: | 183.475,34 | 154.074,22 | 337.549,56 |
| Bonos C: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/08/23: | 28.373,70 | 18.463,89 | 46.837,59 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 5.391,00 | 3.508,14 | 8.899,14 |
| Amortización correspondiente al 28/08/23: | 98.064,41 | 82.350,01 | 180.414,42 |
| Bonos D: | | | |
| Intereses impagados previos | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Intereses vencidos a 28/08/23: | 36.930,18 | 49.240,24 | 86.170,42 |
| Intereses pagados a 28/08/23: | 36.930,18 | 49.240,24 | 86.170,42 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 7.016,73 | 9.355,65 | 16.372,38 |
| Intereses impagados a 28/08/23: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 28/08/23: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Reinversión de las retenciones: | -156.058,35 | -106.342,96 | -262.401,31 |
| IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII): | 2.207.123,69 | 3.049.049,89 | 5.256.173,58 |
| Fondo de Reserva previo(29/05/23): | 2.100.000,00 | 2.800.000,00 | 4.900.000,00 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Intereses pagados Préstamo Gastos Iniciales | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización Préstamo Gastos Iniciales | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Recursos para el próximo Pago | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Margen de Intermediación Financiera | 107.123,69 | 249.049,89 | 356.173,58 |
| Fondo de Reserva (28/08/23): | 2.100.000,00 | 2.800.000,00 | 4.900.000,00 |

Destinatarios: CNMV, AIAF



Nº 3372/23

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.: 917020808
http://www.tda-sgft.com
TDA29/liq.trimAgo23

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 28 de Agosto de 2023

Importes en euros

| I. BONOS A2 ES0377931011 | | |
|---|-------------------|------------------|
| | Sobre 4350 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (27/07/07): | 435.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 126.303.555,00 € | 29.035,30 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 1.167.540,00 € | 268,40 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 5.296.690,50 € | 1.217,63 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 121.006.864,50 € | 27.817,67 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 27,817670% | 27,817670% |
| II. BONOS B ES0377931029 | | |
| | Sobre 174 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (27/07/07): | 17.400.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 8.049.132,12 € | 46.259,38 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 80.511,54 € | 462,71 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 337.549,56 € | 1.939,94 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 7.711.582,56 € | 44.319,44 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 44,319440% | 44,319440% |
| III. BONOS C ES0377931037 | | |
| | Sobre 93 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (27/07/07): | 9.300.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 4.302.122,34 € | 46.259,38 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 46.837,59 € | 503,63 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 180.414,42 € | 1.939,94 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 4.121.707,92 € | 44.319,44 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 44,319440% | 44,319440% |
| IV. BONOS D ES0377931045 | | |
| | Sobre 49 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (27/07/07): | 4.900.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 4.900.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago: | 86.170,42 € | 1.758,58 € |
| 4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | 86.170,42 € | 1.758,58 € |
| 5. Intereses impagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 4.900.000,00 € | 100.000,00 € |
| 8. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| V. EL FONDO | | |
| | Importes en euros | |
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 30/06/23: | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas: | | 132.840.170,65 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas: | | 4.887.460,82 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas: | | 132.884.099,96 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidas: | | 5.927.768,64 € |
| 2. Amortización del período 30/04/23 a 30/06/23: | | 6.021.036,38 € |
| a) Según calendario: | | 2.644.123,87 € |
| b) Amortización anticipada hasta 30/06/23: | | 3.376.912,51 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | |
| a) Último año: | | 7,48% |
| b) Último semestre: | | 9,00% |
| c) Último trimestre: | | 9,39% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | | 0,37% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses: | | 0,10% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | | 4,27% |
| 7. Nivel de Impago (2): | | 0,40% |

(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 impagadas durante el período de tiempo comprendido entre el segundo y el noveno mes inmediatamente anteriores a la correspondiente Fecha de Pago respecto al saldo nominal pendiente de las Participaciones Hipotecarias

Destinatarios: Cedentes; CNMV; AIAF.



Nº: 3051/23

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.: 917020808
<http://www.tda-sgft.com>
TDA29\Infoinver.trim\Ago23

TDA 29 , FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 29/05/23-28/08/23

| I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO | |
|---|---|
| Fecha de Constitución del Fondo | 25 de julio de 2007 |
| Fecha Emisión Bonos de Titulización | 25 de julio de 2007 |
| Fecha Final Amortización Bonos de Titulización (7,48 % TAA) | 28 de mayo de 2027 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca | Banco Sabadell (Guipuzcoano) y Banca March |
| Agente de Pagos | Société Générale, Sucursal en España |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Fitch Ibc/Moody's Investors |
| Calificación | Bonos A2: AAA(sf) (F) / Aa1 (sf) (M) Bonos B: AAA (sf) (F) / Aa2 (sf) (M) Bonos C: A (sf) (F) / Baa3 (sf) (M) Bonos D: CCC (sf) (F) / C (sf) (M) |

| II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO | |
|---|---|
| Nombre | Bonos de Titulización TDA 29, F.T.A. |
| Serie A2: | |
| Código ISIN | ES0377931011 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 435.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 121.006.864,50 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 27.817,67 Euros |

| II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.) | |
|--|---|
| Nombre | Bonos de Titulización TDA 29, F.T.A. |
| Serie B: | |
| Código ISIN | ES0377931029 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 17.400.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 7.711.582,56 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 44.319,44 Euros |
| Serie C: | |
| Código ISIN | ES0377931037 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 9.300.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 4.121.707,92 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 44.319,44 Euros |
| Serie D: | |
| Código ISIN | ES0377931045 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 4.900.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 4.900.000,00 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:29/05/23-28/08/23 |
| * Flujos de Caja del Período:29/05/23-28/08/23 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 28 de Agosto de 2023 |

TDA 29, FTA**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 29/05/23 - 28/08/23**

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | Euros | |
|--|---|----------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| Amortización Bonos Titulización Hip. Amortización Participaciones Hip. | 6.021.036,38 | 5.814.654,48 |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH Intereses recibidos de las PHs Intereses Inversiones Temporales Neto SWAP | 1.138.864,32 82.377,42 348.959,51 | 1.381.059,55 |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: | | 39.350,02 |
| Margen de Intermediación Financiera | | 356.173,58 |
| Total Ingresos/Pagos | <u>7.591.237,63</u> | <u>7.591.237,63</u> |
| Saldo inicial 29/05/23 A Inversiones Temporales (FR + Otros recursos) | 4.900.000,00 | 4.900.000,00 |
| Total | <u>12.491.237,63</u> | <u>12.491.237,63</u> |
| Retenciones practicadas el 28/08/23 A Inversiones Temporales | 262.401,31 | 262.401,31 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº 3373/23**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA29\fluj.trim\Ago23