

## TDA TARRAGONA 1 - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 27/09/22 - 27/12/22

	Euros
<b>I. Situación al 27/09/22:</b>	<b>7.347.840,00</b>
Saldo inicial Fondo de Reserva	7.347.840,00
Otros Recursos	0,00
<b>II. Fondos recibidos del emisor</b>	<b>2.181.347,36</b>
<b>Principal:</b>	
Según calendario hasta 30/11/22:	1.307.093,49
Amort. Anticipada hasta 30/11/22:	676.231,53
<b>Intereses:</b>	<b>198.022,34</b>
<b>III. Subtotal a Cuenta de reinversión (I + II):</b>	<b>9.529.187,36</b>
<b>IV. Total intereses de la reinversión:</b>	<b>0,00</b>
Intereses de la Cta. De Reinversión	0,00
<b>V. Recursos disponibles (III + IV):</b>	<b>9.529.187,36</b>
<b>VI. Gastos:</b>	<b>19.053,51</b>
<b>VII. Liquidación SWAP:</b>	<b>145.953,97</b>
Cantidad a Pagar por la Parte A (Fondo):	198.022,34
Cantidad a Pagar por la Parte B (CECABANK):	343.976,31
<b>VIII. Pago a los Bonos:</b>	<b>2.194.143,97</b>
<b>Bonos A:</b>	
Intereses correspondientes al 27/12/22:	197.727,09
Retenciones practicadas a los bonos:	-37.568,15
Amortización correspondiente al 27/12/22:	1.530.487,53
<b>Bonos B:</b>	
Intereses correspondientes al 27/12/22:	22.117,86
Retenciones practicadas a los bonos:	-4.202,39
Amortización correspondiente al 27/12/22:	151.661,52
<b>Bonos C:</b>	
Intereses correspondientes al 27/12/22:	40.019,70
Retenciones practicadas a los bonos:	-7.603,74
Amortización correspondiente al 27/12/22:	165.707,50
<b>Bonos D:</b>	
Intereses debidos anterior fecha de pago	0,00
Intereses correspondientes al 27/12/22:	86.422,77
Intereses pagados a 27/12/22:	86.422,77
Retenciones practicadas a los bonos:	-16.420,33
Intereses impagados actuales	0,00
Amortización correspondiente al 27/12/22:	0,00
<b>Reinversión o devolución de las retenciones:</b>	<b>65.794,61</b>
<b>IX. Saldo disponible ( V - VI + VII - VIII ):</b>	<b>7.461.943,85</b>
<b>Distribución del saldo disponible:</b>	
Fondo de Reserva 27/09/22:	7.347.840,00
Aportación al Fondo de Reserva	0,00
Otros Recursos	0,00
Margen de Intermediación Financera	114.103,85
<b>Fondo de Reserva 27/12/22:</b>	<b>7.347.840,00</b>

Destinatarios: CNMV, AIAF



Nº: 4857/22

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA TARRAGONA 1\liq.trim\Dic22

# TDA TARRAGONA 1

## Fondo de Titulización de Activos

### INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 27 de diciembre de 2022

Importes en euros

I. BONOS A ES0338455001	Sobre 3597 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (05/12/07):	359.700.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	50.371.308,90 €	14.003,70 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	197.727,09 €	54,97 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	1.530.487,53 €	425,49 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	48.840.821,37 €	13.578,21 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	13,578210%	13,578210%

II. BONOS B ES0338455019	Sobre 111 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (05/12/07):	11.100.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	4.991.461,32 €	44.968,12 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	22.117,86 €	199,26 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	151.661,52 €	1.366,32 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	4.839.799,80 €	43.601,80 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	43,601800%	43,601800%

III. BONOS C ES0338455027	Sobre 119 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (05/12/07):	11.900.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	5.453.724,78 €	45.829,62 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	40.019,70 €	336,30 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	165.707,50 €	1.392,50 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	5.288.017,28 €	44.437,12 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	44,437120%	44,437120%

IV. BONOS D ES0338455035	Sobre 147 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (05/12/07):	14.700.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	7.347.840,57 €	49.985,31 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	86.422,77 €	587,91 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	86.422,77 €	587,91 €
5. Intereses impagados tras 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:	7.347.840,57 €	49.985,31 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	49,985310%	49,985310%

V. EL FONDO	Importes en euros
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 30/11/22:	
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:	58.968.630,70 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:	1.292.606,44 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:	58.983.781,55 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:	3.558.135,98 €
2. Amortización del período 31/08/22 a 30/11/22:	1.983.325,02 €
a) Según calendario:	1.307.093,49 €
b) Amortización anticipada hasta 30/11/22:	676.231,53 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):	
a) Último año:	5,36%
b) Último semestre:	4,49%
c) Último trimestre:	4,37%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:	0,44%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:	0,00%
6. Porcentaje de fallidos (1):	5,69%
7. Porcentaje de préstamos con impago superior a 90 días (2):	0,00%

(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.



Nº: 4858/22

Titulización de Activos, (SGFT),S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA TARRAGONA 1\Infoinver.trimDic22

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**TDA TARRAGONA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

**INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 27/09/22-27/12/22**

**I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO**

Fecha de Constitución del Fondo	30 de noviembre de 2007
Fecha Emisión BTH	30 de junio de 2007
Fecha Final Amortización BTH (5,36% TAA)	29 de junio de 2026
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca	BBVA (Caixa Tarragona)
Agente de Pagos	Banco Santander
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Moody's Investors Service / S&P
Calificación	Bonos A: (M) Aa1 (sf) / (S&P) A+ (sf) Bonos B: (M) Aa1 (sf) / (S&P) A+ (sf) Bonos C: (M) Aa2(sf) Bonos D: (M) Caa3 (sf)

**II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO**

Nombre	Bonos de Titulización Hipotecaria TDA TARRAGONA 1
Serie A:	
Código ISIN	ES0338455001
Nominal en circulación total (inicial)	359.700.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	48.840.821,37 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.00,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	13.578,21 Euros

TDATARRAGONA1\INFO.trim\Dic22

**II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)**

<b>Nombre</b>	<b>Bonos de Titulización Hipotecaria TDA TARRAGONA 1</b>
Serie B:	
Código ISIN	ES0338455019
Nominal en circulación total (inicial)	11.100.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	4.839.799,80 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	43.601,80 Euros
Serie C:	
Código ISIN	ES0338455027
Nominal en circulación total (inicial)	11.900.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	5.288.017,28 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	44.437,12 Euros
Serie D:	
Código ISIN	ES0338455035
Nominal en circulación total (inicial)	14.700.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	7.347.840,57 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	49.985,31 Euros

**III. INFORMACION INCLUIDA**

\* Liquidación del Período: 27/09/22-27/12/22

\* Flujos de Caja del Período: 27/09/22-27/12/22

\* Información a los inversores. Fecha de Pago: 27 de Diciembre de 2022

TDATARRAGONA1\INFO.trim\Dic22

**TDA TARRAGONA 1***Fondo de Titulización de Activos***FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 27/09/2022 - 27/12/2022**

<b>I. INVERSIONES/FINANCIACIONES</b>	<b>Euros</b>	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulación Hip. Amortización Participaciones Hip.	1.983.325,02	1.847.856,55
<b>II. INTERESES</b>		
Intereses pagados a los BTH Intereses recibidos de las PHs Intereses Inversiones Temporales	198.022,34 0,00	346.287,42
<b>III. GASTOS</b>		
Comisiones Periódicas:  Neto SWAP  Margen de intermediación Financiera	145.953,97	19.053,51  114.103,85
<b>Total Ingresos/Pagos</b>	<b>2.327.301,33</b>	<b>2.327.301,33</b>
Saldo inicial 27/09/2022 Aportación al Fondo de Reserva Otros recursos	7.347.840,00	7.347.840,00 0,00
<b>Total</b>	<b>9.675.141,33</b>	<b>9.675.141,33</b>
Retenciones practicadas el 27/12/2022 A Inversiones Temporales	65.794,61	65.794,61

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 4865/22**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA TARRAGONA 1\flujo.trimDic22