

C. N. M. V.
Dirección General de Mercados e Inversores
C/ Edison, 4

Madrid

COMUNICACIÓN DE HECHO RELEVANTE

En relación al Fondo TDA 27, Fondo de Titulización de Activos (en proceso de liquidación), en adelante “El Fondo”, Titulización de Activos, Sociedad Gestora de Fondos de Titulización, S.A., (en adelante, La Sociedad Gestora), comunica el siguiente Hecho Relevante, como continuación al publicado con fecha 30 de septiembre de 2019:

La Sociedad Gestora ha recibido una nueva notificación por parte de JPMorgan Chase Bank, N.A. (en adelante, JP Morgan) en la que comunica lo siguiente:

- Que el cálculo del importe a pagar por el Fondo en relación a la Terminación Anticipada de todos los contratos regidos por el Contrato Marco ISDA de fecha 20 de diciembre de 2006, realizado por JP Morgan, en su condición de “Non-Defaulting Party”, ha sido llevado a cabo de acuerdo a la Sección 6(a) (Right to Terminate Following Event of Default) del Contrato Marco y la Sección 6(d)(i) (Statement) y, de acuerdo con la Sección 6(d) (“Calculations”).
- Que según JP Morgan, el importe, calculado de acuerdo al método “Loss”, asciende a 16.969.015 euros (dieciséis millones novecientos sesenta y nueve mil quince euros).
- Que esta cantidad se considera vencida desde la fecha en la que esta declaración es efectiva, y que coincidirá con la Fecha de Terminación Anticipada, de conformidad con la Sección 12 (“Notices”) del Contrato Marco.
- Que, de acuerdo con la Sección 6 (d) (ii) (“Payment Date”) del Contrato Marco, el importe a satisfacer generará intereses acreedores desde la Fecha de Terminación Anticipada.

- Que, asimismo y de acuerdo a la Sección 11 ("Expenses") del Contrato Marco, JP Morgan se reserva el derecho de reclamar los gastos corrientes razonables, incluidos los honorarios legales, en los que ha incurrido por la aplicación del Contrato Marco o cualquier Documento de Apoyo Crediticio.

Todos los términos en mayúscula se encuentran definidos en el ISDA Master Agreement

La Sociedad Gestora, recibida esta comunicación, ha dado traslado de la misma a los asesores legales al objeto de determinar el alcance de las obligaciones del Fondo y la mejor defensa de los intereses de los bonistas.

En Madrid, a 11 de octubre de 2019

Ramón Pérez Hernández

Consejero-Delegado

Titulización de Activos, SGFT, S.A.