

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

Madrid

COMUNICACIÓN DE HECHO RELEVANTE

En relación al Fondo TDA 28, 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 25 de octubre de 2019:

La Sociedad Gestora, en nombre y representación del Fondo, ha alcanzado un acuerdo con JPMorgan Chase Bank, N.A. (en adelante, JP Morgan) para la terminación anticipada de todos los contratos regidos por el Contrato Marco ISDA de fecha 18 de julio de 2007.

La Sociedad Gestora, en representación del Fondo y buscando el mejor interés de los bonistas, ha considerado, de acuerdo a las opiniones emitidas por los asesores legales y financieros consultados al efecto, que este acuerdo constituye la mejor actuación en beneficio de aquéllos.

Los términos más relevantes del acuerdo alcanzado son los que se enuncian a continuación:

- El Fondo pagará a JP Morgan la cantidad de 9.990.845 euros en concepto de pago liquidativo de los citados contratos. Esta cantidad representa un descuento del 36,50% respecto al Precio de Terminación fijado inicialmente por JP Morgan.
- Esta cantidad será abonada en el menor número de Fechas de Pago posible, siempre atendiendo al orden de prelación de pagos establecido en la Escritura de Constitución del Fondo, que sitúa el abono de este pago liquidativo en el 2º punto de dicha prelación. Por lo tanto, en cada Fecha de Pago, todos los recursos disponibles serán aplicados a este concepto hasta que resulte

totalmente saldado, momento a partir del cual se reanudarán los pagos a los puntos posteriores del orden de prelación de pagos.

- Las cantidades ya abonadas por el Fondo a JP Morgan en concepto de liquidación ordinaria desde el momento de la terminación de los contratos y hasta el momento actual, y que ascienden a 467.535 euros, serán deducidas del total a pagar.
- El importe acordado será el único a abonar, sin devengo de intereses a favor de JP Morgan desde la Fecha de Terminación, según lo acordado.
- En la Fecha de Pago correspondiente al día 28 de enero de 2020, el Fondo abonará a JP Morgan 6.860.468 euros, de tal manera que quedará pendiente de abono un importe de 2.662.842 euros.

En Madrid, a 24 de enero de 2020

Ramón Pérez Hernández

Consejero-Delegado

Titulización de Activos, SGFT, S.A.