

TDA 28 - Fondo de Titulización de Activos (en proceso de liquidación)

LIQUIDACION DEL PERIODO 30/04/18 - 30/07/18

	Euros
	TOTAL
I. Situación inicial	12,63
Fondo de Reserva	0,00
Recursos pendientes de aplicación en la fecha de pago previa	12,63
II. Fondos recibidos del emisor	3.690.877,37
Principal:	
Según calendario hasta 30/06/18:	2.056.357,63
Amort. Anticipada hasta 30/06/18:	992.176,29
Intereses:	466.343,45
Venta de Inmuebles	176.000,00
III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):	3.690.890,00
IV. Total intereses de la reinversión:	-5.457,00
Intereses de la Cta. De Tesorería	-2.225,71
Intereses de la Cta. De Cobros	-1.757,28
Intereses de la Cta. De Amortización Línea Liquidez	-1.474,01
V. Recursos disponibles (III + IV):	3.685.433,00
VI. Gastos:	540.773,67
VII. Aplicación de recursos retenidos en la anterior fecha de pago:	0,00
VII. Liquidación SWAP:	-476.197,41
Cantidad a Pagar por la Parte A (JP Morgan):	-153.395,37
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	322.802,04
VIII. Línea Liquidez	0,00
Intereses	0,00
Amortización	0,00
IX. Pago a los Bonos:	2.668.437,00
Bonos A:	
Intereses correspondientes al 30/07/18:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización teórica correspondiente al 30/07/18:	2.668.437,00
Bonos B:	
Intereses debidos anterior fecha de pago	573.316,38
Intereses vencidos al 30/07/18:	0,00
Intereses pagados al 30/07/18:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados actuales	573.316,38
Amortización correspondiente al 30/07/18:	0,00
Bonos C:	
Intereses debidos anterior fecha de pago	555.337,80
Intereses vencidos al 30/07/18:	2.093,40
Intereses pagados al 30/07/18:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados actuales	557.431,20
Amortización correspondiente al 30/07/18:	0,00
Bonos D:	
Intereses debidos anterior fecha de pago	733.168,80
Intereses vencidos al 30/07/18:	8.590,32
Intereses pagados al 30/07/18:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados actuales	741.759,12
Amortización correspondiente al 30/07/18:	0,00
Bonos E:	
Intereses debidos anterior fecha de pago	2.407.828,68
Intereses vencidos al 30/07/18:	54.709,02
Intereses pagados al 30/07/18:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados actuales	2.462.537,70
Amortización correspondiente al 30/07/18:	0,00
Bonos F:	
Intereses debidos anterior fecha de pago	956.128,05
Intereses vencidos al 30/07/18:	21.061,89
Intereses pagados al 30/07/18:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados actuales	977.189,94
Amortización correspondiente al 30/07/18:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	0,00
X. Saldo disponible:	24,92
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva (30/04/18)	0,00
Aportación al Fondo de Reserva	0,00
Intereses préstamo subordinado G.I. pagados	0,00
Amortización préstamo subordinado G.I.	0,00
Otros Recursos (dif. Bonos - PHs)	24,92
Margen de Intermediación Financiera	0,00
Fondo de Reserva 30/07/18:	0,00
Cantidad Dotada Línea Liquidez a 30/04/18	1.477.912,96
Cantidad Dotada Línea Liquidez a 30/07/18	1.477.912,96

Destinatarios: CNMV, AIAF



Nº: 2982/18

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.:917020808
http://www.tda-sgft.com
TDA28\liq.trim\Jul18

TDA 28 (en proceso de liquidación)

Fondo de Titulización de Activos

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 30 de Julio de 2018

		Importes en euros	
I. BONOS A ES0377930005		Sobre 4140 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (23/07/2007):	414.000.000,00 €		100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	213.210.828,00 €		51.500,20 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	2.668.437,00 €		644,55 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	210.542.391,00 €		50.855,65 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	50,855650%		50,855650%
II. BONOS B ES0377930013		Sobre 117 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (23/07/2007):	11.700.000,00 €		100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	11.700.000,00 €		100.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	573.316,38 €		4.900,14 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	11.700.000,00 €		100.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%		100,000000%
III. BONOS C ES0377930021		Sobre 90 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (23/07/2007):	9.000.000,00 €		100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	9.000.000,00 €		100.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	2.093,40 €		23,26 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	557.431,20 €		6.193,68 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	9.000.000,00 €		100.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%		100,000000%
IV. BONOS D ES0377930039		Sobre 72 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (23/07/2007):	7.200.000,00 €		100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	7.200.000,00 €		100.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	8.590,32 €		119,31 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	741.759,12 €		10.302,21 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	7.200.000,00 €		100.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%		100,000000%
V. BONOS E ES0377930047		Sobre 81 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (23/07/2007):	8.100.000,00 €		100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	8.100.000,00 €		100.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	54.709,02 €		675,42 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	2.462.537,70 €		30.401,70 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	8.100.000,00 €		100.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%		100,000000%
VI. BONOS F ES0377930054		Sobre 27 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (23/07/2007):	1.350.000,00 €		50.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	1.350.000,00 €		50.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	21.061,89 €		780,07 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	977.189,94 €		36.192,22 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	1.350.000,00 €		50.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%		100,000000%
VII. EL FONDO		Importes en euros	
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 30/06/18:			
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:			145.049.986,84 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:			73.902.911,15 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:			145.082.590,47 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:			103.827.740,21 €
2. Amortización del período 31/03/18 a 30/06/18:			3.048.533,92 €
a) Según calendario:			2.056.357,63 €
b) Amortización anticipada hasta 30/06/18:			992.176,29 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):			
b) Último año:			2,87%
c) Último semestre:			2,49%
d) Último trimestre:			2,66%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:			1,16%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:			0,16%
6. Porcentaje de fallidos (1):			41,71%
7. Porcentaje de préstamos con impago superior a 90 días (2):			0,57%

(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.

Destinatarios: Cedentes; CNMV; AIAF



Nº: 2983/18

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.: 917020808
<http://www.tda-sgft.com>
TDA28Infoinver.trimJul18

TDA 28 , FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS (en proceso de liquidación)
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 30/04/18-30/07/18

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO	
Fecha de Constitución del Fondo	18 de julio de 2007
Fecha Emisión BTH	18 de julio de 2007
Fecha Final Amortización BTH (2,87% TAA)	29 de abril de 2030
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca	BBVA (Caixa Terrassa) Credifimo
Agente de Pagos	BNP PARIBAS
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Fitch Ibcá
Calificación	Bonos A: (F) CC (sf) Bonos B: (F) C (sf) Bonos C: (F) C (sf) Bonos D: (F) C (sf) Bonos E: (F) C (sf) Bonos F: (F) C (sf)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO	
Nombre	Bonos de Titulización TDA 28, F.T.A. (en proceso de liquidación)
Serie A:	
Código ISIN	ES0377930005
Nominal en circulación total (inicial)	414.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	210.542.391,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	50.855,65 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0377930013
Nominal en circulación total (inicial)	11.700.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	11.700.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)	
Nombre	Bonos de Titulización TDA 28, F.T.A. (en proceso de liquidación)
Serie C:	
Código ISIN	ES0377930021
Nominal en circulación total (inicial)	9.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	9.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie D:	
Código ISIN	ES0377930039
Nominal en circulación total (inicial)	7.200.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	7.200.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie E:	
Código ISIN	ES0377930047
Nominal en circulación total (inicial)	8.100.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	8.100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie F:	
Código ISIN	ES0377930054
Nominal en circulación total (inicial)	1.350.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	1.350.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	50.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	50.000,00 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA
* Liquidación del Período:30/04/18-30/07/18
* Flujos de Caja del Período:30/04/18-30/07/18
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 30 de Julio de 2018

TDA 28 (en proceso de liquidación)**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 30/04/18 - 30/07/18**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip.		2.668.437,00
Amortización Participaciones Hip.	3.048.533,92	
Venta de Inmueble	176.000,00	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
II. INTERESES		
Intereses pagados línea de liquidez		0,00
Intereses pagados a los BTH		0,00
Intereses recibidos de las PHs	466.343,45	
Intereses Inversiones Temporales	-5.457,00	
Intereses Ptmos. Subordinados		0,00
III. GASTOS		1.016.971,08
Comisiones y Gastos:		540.773,67
Neto SWAP		476.197,41
Margen de Intermediación Financiera		0,00
Total Ingresos/Pagos	3.685.420,37	3.685.408,08
Saldo inicial 30/04/18	12,63	
A Inversiones Temporales		0,00
Otros Recursos		24,92
Total	3.685.433,00	3.685.433,00
Retenciones practicadas el 30/07/18	0,00	
A Inversiones Temporales		0,00

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 2990/18**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA28fluj.trimJul18