

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

LIQUIDACION DEL PERIODO 30/01/17 - 28/04/17

	Euros
	TOTAL
I. Situación inicial	1.477.928,26
Fondo de Reserva	0,00
Cantidad dotada Línea de Liquidez	1.477.912,96
Otros recursos anterior periodo	15,30
II. Fondos recibidos del emisor	5.500.800,62
Principal:	
Según calendario hasta 31/03/17:	2.889.693,02
Amort. Anticipada hasta 31/03/17:	1.511.528,04
Intereses:	786.217,72
Venta de Inmuebles	313.361,84
III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):	6.978.728,88
IV. Total intereses de la reinversión:	-7.137,09
Intereses de la Cta. De Tesorería	-3.422,10
Intereses de la Cta. De Cobros	-2.257,20
Intereses de la Cta. De Amortización Línea Liquidez	-1.457,79
V. Recursos disponibles (III + IV):	6.971.591,79
VI. Gastos:	402.742,23
VII. Liquidación SWAP:	-534.316,44
Cantidad a Pagar por la Parte A (JP Morgan):	-164.409,60
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	369.906,84
VIII. Línea Liquidez	0,00
Intereses	0,00
Amortización	0,00
IX. Pago a los Bonos:	4.309.615,80
Bonos A:	
Intereses correspondientes al 28/04/17:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización teórica correspondiente al 28/04/17:	4.556.615,80
Provisión resolución judicial	247.000,00
Amortización real correspondiente al 28/04/17:	4.309.615,80
Bonos B:	
Intereses debidos anterior fecha de pago	573.316,38
Intereses vencidos al 28/04/17:	0,00
Intereses pagados al 28/04/17:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados actuales	573.316,38
Amortización correspondiente al 28/04/17:	0,00
Bonos C:	
Intereses debidos anterior fecha de pago	544.987,80
Intereses vencidos al 28/04/17:	2.024,10
Intereses pagados al 28/04/17:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados actuales	547.011,90
Amortización correspondiente al 28/04/17:	0,00
Bonos D:	
Intereses debidos anterior fecha de pago	690.309,36
Intereses vencidos al 28/04/17:	8.307,36
Intereses pagados al 28/04/17:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados actuales	698.616,72
Amortización correspondiente al 28/04/17:	0,00
Bonos E:	
Intereses debidos anterior fecha de pago	2.134.385,64
Intereses vencidos al 28/04/17:	52.905,96
Intereses pagados al 28/04/17:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados actuales	2.187.291,60
Amortización correspondiente al 28/04/17:	0,00
Bonos F:	
Intereses debidos anterior fecha de pago	850.835,34
Intereses vencidos al 28/04/17:	20.367,72
Intereses pagados al 28/04/17:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados actuales	871.203,06
Amortización correspondiente al 28/04/17:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	0,00
X. Saldo disponible:	1.477.917,32
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva (30/01/17)	0,00
Aportación al Fondo de Reserva	0,00
Dotación Amortización Línea Liquidez	1.477.912,96
Intereses préstamo subordinado G.I. pagados	0,00
Amortización préstamo subordinado G.I.	0,00
Otros Recursos (dif. Bonos - PHs)	4,36
Margen de Intermediación Financiera	0,00
Fondo de Reserva 28/04/17:	0,00
Total de la Línea de Liquidez dispuesta a 28/04/17:	3.234.594,65

Destinatarios: CNMV, AIAF



Nº: 1770/17

Titulización de Activos, SGFT,S./

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

http://www.tda-sgft.com

TDA28liq.trimAbr17

TDA 28 (en proceso de liquidación)

Fondo de Titulización de Activos

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 28 de Abril de 2017

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:		231.621.573,60 €	55.947,24 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:		0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:		4.309.615,80 €	1.040,97 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:		227.311.957,80 €	54.906,27 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:		54,906270%	54,906270%
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:		2.024,10 €	22,49 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:		0,00 €	0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:		547.011,90 €	6.077,91 €
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:		8.307,36 €	115,38 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:		0,00 €	0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:		698.616,72 €	9.703,01 €
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:		52.905,96 €	653,16 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:		0,00 €	0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:		2.187.291,60 €	27.003,60 €
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:		20.367,72 €	754,36 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:		0,00 €	0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:		871.203,06 €	32.266,78 €
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 31/03/17:		
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:		160.285.388,31 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:		79.392.064,50 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:		160.341.334,11 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:		107.000.243,97 €
2. Amortización del período 31/12/16 a 31/03/17:		
a) Según calendario:		2.889.693,02 €
b) Amortización anticipada hasta 31/03/17:		1.511.528,04 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):		
b) Ultimo año:		3,02%
c) Ultimo semestre:		4,32%
d) Ultimo trimestre:		3,64%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:		1,28%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:		0,40%
6. Porcentaje de fallidos (1):		40,02%
7. Porcentaje de préstamos con impago superior a 90 días (2):		0,85%

(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: 1771/17

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.: 917020808
http://www.tda-sgft.com
TDA28Unfoinver.trimAbr17

TDA 28 , FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS (en proceso de liquidación)

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 30/01/17-28/04/17

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 (3,02% TAA)	29 de enero de 2029
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 Ibcra
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)	227.311.957,80 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	54.906,27 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:30/01/17-28/04/17
* Flujos de Caja del Período:30/01/17-28/04/17
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 28 de Abril de 2017

TDA 28 (en proceso de liquidación)**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 30/01/17 - 28/04/17**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip.		4.309.615,80
Amortización Participaciones Hip.	4.401.221,06	
Venta de Inmueble	313.361,84	
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	786.217,72	
Intereses Inversiones Temporales	-7.137,09	
Intereses Ptmos. Subordinados		0,00
III. GASTOS		1.184.058,67
Comisiones y Gastos:		649.742,23
Neto SWAP		534.316,44
Margen de Intermediación Financiera		0,00
Total Ingresos/Pagos	5.493.663,53	5.493.674,47
Saldo inicial 30/01/17	1.477.928,26	
A Inversiones Temporales		1.477.912,96
Otros Recursos		4,36
Total	6.971.591,79	6.971.591,79
Retenciones practicadas el 28/04/17	0,00	
A Inversiones Temporales		0,00

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 1778/17**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA 28Fluj.trim\Abr17