

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: TDA 23, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 7828
NIF Fondo: V84286491
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2022

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:
(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2022		Periodo anterior 31/12/2021
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	59.450	1001	62.401
I. Activos financieros a largo plazo	0002	59.450	1002	62.401
1. Activos titulizados	0003	59.450	1003	62.401
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	41.393	1004	43.480
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	15.778	1005	16.403
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007	0	1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008	0	1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009	0	1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010	0	1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016	0	1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	0
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022	0	1022	0
1.20 Otros	0023	0	1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	2.316	1025	2.554
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-36	1027	-36
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2022		Periodo anterior 31/12/2021
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	17.051	1041	17.292
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	11.177	1043	11.535
1. Activos titulizados	0044	11.048	1044	11.338
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	6.080	1045	6.268
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	2.034	1046	2.049
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048	0	1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049	0	1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050	0	1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051	0	1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052	0	1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053	0	1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054	0	1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055	0	1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056	0	1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057	0	1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058	0	1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060	0	1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061	0	1061	0
1.18 Bonos de titulización	0062	0	1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063	0	1063	0
1.20 Otros	0064	0	1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	19	1065	21
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	4	1066	5
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	2.877	1067	2.958
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	63	1068	66
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-30	1069	-30
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	129	1074	197
3.1 Valores representativos de deuda	0075	0	1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076	0	1076	0
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	129	1077	197
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	5.874	1085	5.758
1. Tesorería	0086	5.874	1086	5.758
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	76.501	1088	79.693

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2022		Periodo anterior 31/12/2021
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	65.384	1089	68.286
I. Provisiones a largo plazo	0090	5.778	1090	5.959
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	5.778	1092	5.959
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	59.606	1094	62.326
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	54.446	1095	57.166
1.1 Series no subordinadas	0096	40.639	1096	43.359
1.2 Series subordinadas	0097	13.807	1097	13.807
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	5.160	1101	5.160
2.1 Préstamo subordinado	0102	5.160	1102	5.160
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	0	1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2022		Periodo anterior 31/12/2021
B) PASIVO CORRIENTE	0117	11.187	1117	11.472
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	0119	0	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	11.184	1123	11.469
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	11.035	1124	11.319
1.1 Series no subordinadas	0125	11.034	1125	11.319
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	0	1128	0
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	19	1131	20
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	0	1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	0	1136	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	19	1137	20
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	128	1139	128
3.1 Derivados de cobertura	0140	128	1140	128
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	2	1143	2
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	2	1146	2
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	3	1148	3
1. Comisiones	0149	2	1149	2
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	2	1150	2
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	1	1157	1
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-70	1158	-65
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-70	1160	-65
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	76.501	1162	79.693

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2022		Acumulado anterior 31/03/2021
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	161	1201	239	2201	161	3201	239
1.1 Activos titulizados	0202	161	1202	239	2202	161	3202	239
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-16	1204	-21	2204	-16	3204	-21
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-2	1205	-2	2205	-2	3205	-2
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-5	1206	-6	2206	-5	3206	-6
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-9	1207	-13	2207	-9	3207	-13
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-144	1208	-206	2208	-144	3208	-206
A) MARGEN DE INTERESES	0209	1	1209	11	2209	1	3209	11
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210	0	3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-183	1217	-101	2217	-183	3217	-101
7.1 Servicios exteriores	0218	-3	1218	0	2218	-3	3218	0
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-3	1219	0	2219	-3	3219	0
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-179	1224	-101	2224	-179	3224	-101
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-24	1225	-22	2225	-24	3225	-22
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227	0	3227	0
7.3.4 Comisión variable	0228	-156	1228	-79	2228	-156	3228	-79
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	0	2231	0	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	0	2232	0	3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	182	1234	90	2234	182	3234	90
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	182	1236	90	2236	182	3236	90
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238	0	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	0	2239	0	3239	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2022		Acumulado anterior 31/03/2021
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-179	1300	-64	2300	-179	3300	-64
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	0	1301	37	2301	0	3301	37
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	167	1302	241	2302	167	3302	241
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-2	1303	-2	2303	-2	3303	-2
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-150	1305	-187	2305	-150	3305	-187
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-6	1307	-2	2307	-6	3307	-2
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-9	1308	-13	2308	-9	3308	-13
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-179	1309	-101	2309	-179	3309	-101
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-23	1310	-22	2310	-23	3310	-22
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	-156	1313	-79	2313	-156	3313	-79
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	0	1315	0	2315	0	3315	0
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	296	1322	18	2322	296	3322	18
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	299	1325	18	2325	299	3325	18
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	2.183	1326	2.583	2326	2.183	3326	2.583
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	685	1327	4.394	2327	685	3327	4.394
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	434	1328	186	2328	434	3328	186
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-3.005	1331	-7.145	2331	-3.005	3331	-7.145
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-3	1332	0	2332	-3	3332	0
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-3	1336	0	2336	-3	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	116	1337	-46	2337	116	3337	-46
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	5.758	1338	7.828	2338	5.758	3338	7.828
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	5.874	1339	7.782	2339	5.874	3339	7.782

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2022		Acumulado anterior 31/03/2021
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-150	1357	-187	2357	-150	3357	-187
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-150	1358	-187	2358	-150	3358	-187
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359	0	3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	144	1360	206	2360	144	3360	206
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361	0	3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	6	1362	-19	2362	6	3362	-19
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL, BBVA, BANCA MARCH

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/03/2022								Situación cierre anual anterior 31/12/2021								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380	8,28	0400	0,00	0420	0,00	0440	6,41	1380	8,47	1400	0,00	1420	0,00	1440	9,83	2380	0,00	2400	0,00	2420	0,00	2440	10,00
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	4,85	0401	0,22	0421	0,00	0441	7,55	1381	4,69	1401	0,22	1421	0,00	1441	12,69	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	10,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL, BBVA, BANCA MARCH

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	55	0467	17	0474	2	0481	0	0488	19	0495	2.198	0502	0	0509	2.217
De 1 a 3 meses	0461	16	0468	69	0475	2	0482	0	0489	72	0496	480	0503	0	0510	551
De 3 a 6 meses	0462	0	0469	0	0476	0	0483	0	0490	0	0497	0	0504	0	0511	0
De 6 a 9 meses	0463	4	0470	65	0477	0	0484	0	0491	66	0498	145	0505	0	0512	211
De 9 a 12 meses	0464	1	0471	3	0478	0	0485	0	0492	3	0499	48	0506	0	0513	51
Más de 12 meses	0465	76	0472	2.328	0479	63	0486	489	0493	2.880	0500	2.604	0507	0	0514	5.484
Total	0466	152	0473	2.483	0480	68	0487	489	0494	3.040	0501	5.475	0508	0	1515	8.514

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total		Valor garantía		Valor Garantía con Tasación > 2 años		% Deuda / v. Tasación	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total													
Hasta 1 mes	0515	55	0522	17	0529	2	0536	0	0543	19	0550	2.198	0557	0	0564	2.217	0571	7.029	0578	7.029	0584	31,54
De 1 a 3 meses	0516	16	0523	69	0530	2	0537	0	0544	72	0551	480	0558	0	0565	551	0572	1.969	0579	1.969	0585	28,01
De 3 a 6 meses	0517	0	0524	0	0531	0	0538	0	0545	0	0552	0	0559	0	0566	0	0573	0	0580	0	0586	0,00
De 6 a 9 meses	0518	4	0525	65	0532	0	0539	0	0546	66	0553	145	0560	0	0567	211	0574	1.105	0581	1.105	0587	19,07
De 9 a 12 meses	0519	1	0526	3	0533	0	0540	0	0547	3	0554	48	0561	0	0568	51	0575	170	0582	170	0588	29,85
Más de 12 meses	0520	76	0527	2.328	0534	63	0541	489	0548	2.880	0555	2.604	0562	0	0569	5.484	0576	12.675	0583	12.675	0589	43,27
Total	0521	152	0528	2.483	0535	68	0542	489	0549	3.040	0556	5.475	0563	0	0570	8.514	0577	22.949			0590	37,10

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL, BBVA, BANCA MARCH

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 17/03/2005	
Inferior a 1 año	0600	2.103	1600	2.219	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	1.582	1601	1.225	2601	37
Entre 2 y 3 años	0602	1.461	1602	2.233	2602	73
Entre 3 y 4 años	0603	934	1603	937	2603	503
Entre 4 y 5 años	0604	1.906	1604	1.491	2604	877
Entre 5 y 10 años	0605	28.505	1605	29.350	2605	20.860
Superior a 10 años	0606	33.987	1606	36.259	2606	837.650
Total	0607	70.478	1607	73.713	2607	860.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	9,09	1608	9,25	2608	24,00

Antigüedad	Situación actual 31/03/2022					
	Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 17/03/2005	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	18,87	1609	18,63	2609	1,82

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL, BBVA, BANCA MARCH

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/03/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Situación inicial 17/03/2005			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.740	0630	56.520	1620	1.755	1630	56.960	2620	1.089	2630	79.012
40% - 60%	0621	163	0631	11.591	1621	204	1631	14.295	2621	1.719	2631	171.699
60% - 80%	0622	22	0632	2.153	1622	23	1632	2.246	2622	3.857	2632	442.079
80% - 100%	0623	2	0633	213	1623	2	1633	213	2623	1.528	2633	167.209
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	1.927	0638	70.478	1628	1.984	1638	73.713	2628	8.193	2638	860.000
Media ponderada (%)	0639	30,47	0649		1639	30,98	1649		2639	67,49	2649	

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL, BBVA, BANCA MARCH

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 17/03/2005	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,86	1650	0,90	2650	3,41
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,00	1651	4,00	2651	8,51
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	2,00

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL, BBVA, BANCA MARCH

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/03/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Situación inicial 17/03/2005			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	15	0683	439	1660	15	1683	469	2660	119	2683	14.624
Aragón	0661	3	0684	34	1661	3	1684	38	2661	19	2684	1.771
Asturias	0662	0	0685	0	1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663	438	0686	18.281	1663	448	1686	18.948	2663	1.326	2686	144.881
Canarias	0664	185	0687	6.929	1664	187	1687	7.240	2664	722	2687	73.951
Cantabria	0665	4	0688	140	1665	4	1688	145	2665	32	2688	3.559
Castilla-León	0666	12	0689	468	1666	13	1689	485	2666	42	2689	4.519
Castilla La Mancha	0667	13	0690	565	1667	13	1690	581	2667	52	2690	6.072
Cataluña	0668	891	0691	29.284	1668	920	1691	30.651	2668	3.678	2691	361.890
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	1	2693	27
Galicia	0671	0	0694	0	1671	0	1694	0	2671	4	2694	235
Madrid	0672	140	0695	6.675	1672	146	1695	6.958	2672	795	2695	98.767
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	4	0697	98	1674	4	1697	101	2674	38	2697	3.037
Navarra	0675	23	0698	725	1675	23	1698	753	2675	130	2698	13.690
La Rioja	0676	11	0699	423	1676	11	1699	441	2676	44	2699	3.745
Comunidad Valenciana	0677	85	0700	2.856	1677	89	1700	3.114	2677	611	2700	59.244
País Vasco	0678	103	0701	3.560	1678	108	1701	3.787	2678	580	2701	69.989
Total España	0679	1.927	0702	70.478	1679	1.984	1702	73.713	2679	8.193	2702	860.000
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	1.927	0705	70.478	1682	1.984	1705	73.713	2682	8.193	2705	860.000

TDA 23, FTA

S.05.1

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL, BBVA, BANCA MARCH

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/03/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Situación inicial 17/03/2005			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	2,35			1710	2,27			2710	0,50		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2022			Situación cierre anual anterior 31/12/2021			Situación inicial 17/03/2005					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Principal pendiente		Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0377984002	SERIE A	8.372	6.172	51.673	8.372	6.531	54.678	8.372	100.000	837.200			
ES0377984010	SERIE B	163	60.559	9.871	163	60.559	9.871	163	100.000	16.300			
ES0377984028	SERIE C	65	60.559	3.936	65	60.559	3.936	65	100.000	6.500			
Total		0723	8.600	0724	65.481	1723	8.600	1724	68.485	2723	8.600	2724	860.000

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado						
									0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737
ES0377984002	SERIE A	NS	EURIBOR 3 m	0,09	0,00	0	0	SI	51.673	0	0	0	51.673	0			
ES0377984010	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,30	0,00	0	0	SI	9.871	0	0	0	9.871	0			
ES0377984028	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,75	0,26	0	0	SI	3.936	0	0	0	3.937	0			
Total						0740	0	0741	0	0743	65.481	0744	0	0745	65.481	0746	0

	Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 17/03/2005	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,01	0748	0,01	0749	2,23

S.05.2
Denominación Fondo: TDA 23, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/03/2022
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2022								Situación periodo comparativo anterior 31/03/2021							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0377984002	SERIE A	3.005	785.527	0	101.919	5.935	769.442	0	101.919								
ES0377984010	SERIE B	0	6.429	0	3.590	865	6.429	0	3.590								
ES0377984028	SERIE C	0	2.564	2	1.887	345	2.564	2	1.879								
Total		0754	3.005	0755	794.519	0756	2	0757	107.395	1754	7.145	1755	778.435	1756	2	1757	107.387

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 31/03/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Situación inicial 17/03/2005
				0760	0761	0762
ES0377984002	SERIE A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0377984010	SERIE B	29/07/2021	MDY	Aa1	Aa1	A2
ES0377984028	SERIE C	29/07/2021	MDY	A3	A3	Baa3

S.05.2
Denominación Fondo: TDA 23, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/03/2022
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 17/03/2005	
Inferior a 1 año	0765	65.481	1765	68.485	2765	29.113
Entre 1 y 2 años	0766	0	1766	0	2766	28.051
Entre 2 y 3 años	0767	0	1767	0	2767	28.986
Entre 3 y 4 años	0768	0	1768	0	2768	29.904
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	0	2769	30.753
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	0	2770	164.463
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	548.730
Total	0772	65.481	1772	68.485	2772	860.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,23	1773	0,98	2773	24,28

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 17/03/2005	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	5.160	1775	5.160	2775	10.320
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	5.160	1776	5.160	2776	10.320
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	7,88	1777	7,53	2777	1,20
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Ver Nota S.06	1778	Ver Nota S.06	2778	Ver Nota S.06
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786		1786		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	78,91	1792	79,84	2792	97,35
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 31/03/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Situación inicial 17/03/2005	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Pago interés recibido cartera/Recibo interes sobre importe bonos	HSBC	TRIMESTRAL	Tipos Interés de la cartera	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los préstamos al inicio del periodo	Tipo de Referencia de los Bonos + MMP + 0,55%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Bonos	-128	-128		
Total							0808 -128	0809 -128	0810	

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 17/03/2005		Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 17/03/2005			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	210	7006	211	7009	0,33	7012	0,31	7015	0,33		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	210	7008	211	7011	0,33	7014	0,31	7017	0,33	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	6.009	7024	6.367	7027	8,53	7030	8,64	7033	8,44		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	6.009	7026	6.367	7029	8,53	7032	8,64	7035	8,44	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO


CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
SERIE C - ES0377984028	1,00	0,33	0,33	II.11.3 Capítulo II
SERIE B - ES0377984010	10,00	8,20	8,33	II.11.3 Capítulo II
SERIE C - ES0377984028	5,30	21,09	20,16	II.11.3 Capítulo II
SERIE C - ES0377984028	10,00	8,20	8,33	II.11.3 Capítulo II
SERIE B - ES0377984010	5,30	21,09	20,16	II.11.3 Capítulo II
SERIE B - ES0377984010	1,00	0,33	0,33	II.11.3 Capítulo II
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0377984028	100,00	83,17	83,17	V.4.2.2 Capítulo V
SERIE B - ES0377984010	100,00	69,83	69,83	V.4.2.2 Capítulo V
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		7,88	7,26	3.3 Capítulo V
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862		2862	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de las Participaciones y Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,052	4862		5862	23	6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864		1864		2864		3864		4864		5864		6864		7864		8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Multicedente
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Capítulo V.3.2.

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo											Total		
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872														
Margen de intereses	0873														
Deterioro de activos financieros (neto)	0874														
Dotaciones a provisiones (neto)	0875														
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876														
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877														
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878														
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879														
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880														
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881														
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882														
Comisión variable pagada	0883														
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884														

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885	22/03/2022											
Saldo inicial	0886	4.969											
Cobros del periodo	0887	3.533											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-23											
Pagos por derivados	0889	-150											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-5.160											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-3.006											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-6											
Resto pagos/retenciones	0893	0											
Saldo disponible	0894	156											
Liquidación de comisión variable	0895	156											156

Denominación Fondo: TDA 23, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

INFORME SOBRE EL CUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE RIESGOS