

| TDA 27 - Fondo de Titulización de Activos (en proceso de liquidación) | |
|--|---------------------|
| <i>LIQUIDACION DEL PERIODO 28/03/23 - 28/06/23</i> | |
| | Euros |
| | TOTAL |
| I. Situación inicial | 1,91 |
| Fondo de Reserva | 0,00 |
| Saldo Inicial Cuenta Tesorería | 1,91 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 7.894.499,91 |
| Principal: | |
| Según calendario hasta 31/05/23: | 3.071.961,99 |
| Amort. Anticipada hasta 31/05/23: | 3.221.716,53 |
| Intereses: | 1.313.024,38 |
| Ingresos por venta de inmueble: | 287.797,01 |
| III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II): | 7.894.501,82 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | 39.435,03 |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | 17.804,85 |
| Intereses de la Cta. De Cobros | 16.310,51 |
| Intereses de la Cta. De Amortización Línea Líquidez | 5.319,67 |
| V. Disposición Línea Líquidez en Fecha de Pago actual | 0,00 |
| VI. Recursos disponibles (III + IV + V): | 7.933.936,85 |
| VII. Varios: | 228.488,25 |
| VIII. Línea Líquidez | 65.074,52 |
| Intereses | 65.074,52 |
| Amortización | 0,00 |
| IX. Pago a los Bonos: | 7.640.362,73 |
| Bonos A3: | |
| Intereses correspondientes al 28/06/23: | 1.136.170,84 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -215.872,46 |
| Amortización correspondiente al 28/06/23: | 6.504.191,89 |
| Bonos B: | |
| Intereses vencidos al 28/06/23: | 114.559,63 |
| Intereses pagados al 28/06/23: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Intereses impagados al 28/06/23: | 243.975,58 |
| Amortización correspondiente al 28/06/23: | 0,00 |
| Bonos C: | |
| Intereses vencidos al 28/06/23: | 79.262,04 |
| Intereses pagados al 28/06/23: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Intereses impagados al 28/06/23: | 272.971,74 |
| Amortización correspondiente al 28/06/23: | 0,00 |
| Bonos D: | |
| Intereses vencidos al 28/06/23: | 126.474,60 |
| Intereses pagados al 28/06/23: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Intereses impagados al 28/06/23: | 1.026.883,20 |
| Amortización correspondiente al 28/06/23: | 0,00 |
| Bonos E: | |
| Intereses vencidos al 28/06/23: | 185.150,00 |
| Intereses pagados al 28/06/23: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Intereses impagados al 28/06/23: | 4.256.459,20 |
| Amortización correspondiente al 28/06/23: | 0,00 |
| Bonos F: | |
| Intereses vencidos al 28/06/23: | 9.238,32 |
| Intereses pagados al 28/06/23: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Intereses impagados al 28/06/23: | 337.039,08 |
| Amortización correspondiente al 28/06/23: | 0,00 |
| Reinversión o devolución de las retenciones: | 215.872,46 |
| X. Saldo disponible (VI - VII - VIII - IX): | 11,35 |
| Distribución del saldo disponible: | |
| Fondo de Reserva (28/03/23) | 0,00 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 0,00 |
| Dotación Amortización Línea Líquidez | 0,00 |
| Intereses préstamo subordinado G.I. pagados | 0,00 |
| Amortización préstamo subordinado G.I. | 0,00 |
| Intereses préstamo participativo | 0,00 |
| Amortización préstamo participativo | 0,00 |
| Otros Recursos para el siguiente pago | 11,35 |
| Margen de Intermediación Financiera | 0,00 |
| Fondo de Reserva 28/06/23: | 0,00 |
| Cantidad Dotada Línea Líquidez a 28/03/23 | 900.884,40 |
| Cantidad Dotada Línea Líquidez a 28/06/23 | 900.884,40 |

Destinatarios: CNMV; AIAF



Nº: 2349/23

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.:917020808
<http://www.tda-sgft.com>
TDA27\liq.trim\Jun23

TDA 27 (en proceso de liquidación)
Fondo de Titulización de Activos
INFORMACION A LOS INVERSORES
FECHA DE PAGO: 28 de Junio de 2023

Importes en euros

| I. BONOS A3 ES0377954021 | | |
|---|------------------|--------------|
| | Sobre 1813 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/12/2006): | 181.300.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 138.284.834,52 € | 76.274,04 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 1.136.170,84 € | 626,68 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 6.504.191,89 € | 3.587,53 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 131.780.642,63 € | 72.686,51 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 72,686510% | 72,686510% |

| II. BONOS B ES0377954039 | | |
|---|-----------------|--------------|
| | Sobre 139 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/12/2006): | 13.900.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 13.900.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses debidos en la anterior fecha de pago: | 129.415,95 € | 931,05 € |
| 4. Intereses devengados en esta Fecha de Pago: | 114.559,63 € | 824,17 € |
| 5. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 6. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago: | 243.975,58 € | 1.755,22 € |
| 7. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 8. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 13.900.000,00 € | 100.000,00 € |
| 9. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |

| III. BONOS C ES0377954047 | | |
|---|----------------|--------------|
| | Sobre 93 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/12/2006): | 9.300.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 9.300.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses debidos en la anterior fecha de pago: | 193.709,70 € | 2.082,90 € |
| 4. Intereses devengados en esta Fecha de Pago: | 79.262,04 € | 852,28 € |
| 5. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 6. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago: | 272.971,74 € | 2.935,18 € |
| 7. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 8. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 9.300.000,00 € | 100.000,00 € |
| 9. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |

| IV. BONOS D ES0377954054 | | |
|---|-----------------|--------------|
| | Sobre 140 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/12/2006): | 14.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 14.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses debidos en la anterior fecha de pago: | 900.408,60 € | 6.431,49 € |
| 4. Intereses devengados en esta Fecha de Pago: | 126.474,60 € | 903,39 € |
| 5. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 6. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago: | 1.026.883,20 € | 7.334,88 € |
| 7. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 8. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 14.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 9. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |

| V. BONOS E ES0377954062 | | |
|---|-----------------|--------------|
| | Sobre 140 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/12/2006): | 14.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 14.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses debidos en la anterior fecha de pago: | 4.071.309,20 € | 29.080,78 € |
| 4. Intereses devengados en esta Fecha de Pago: | 185.150,00 € | 1.322,50 € |
| 5. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 6. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago: | 4.256.459,20 € | 30.403,28 € |
| 7. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 8. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 14.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 9. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |

| VI. BONOS F ES0377954070 | | |
|---|---------------|--------------|
| | Sobre 6 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/12/2006): | 600.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 600.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses debidos en la anterior fecha de pago: | 327.800,76 € | 54.633,46 € |
| 4. Intereses devengados en esta Fecha de Pago: | 9.238,32 € | 1.539,72 € |
| 5. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 6. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago: | 337.039,08 € | 56.173,18 € |
| 7. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 8. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 600.000,00 € | 100.000,00 € |
| 9. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |

| VII. EL FONDO | | |
|---|-------------------|-----------------------|
| | Importes en euros | |
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/05/23: | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas: | | 131.492.167,04 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas: | | 48.748.455,73 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas : | | 131.559.501,63 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidas: | | 76.107.895,63 € |
| 2. Amortización del período 28/02/23 a 31/05/23: | | 6.293.678,52 € |
| a) Según calendario: | | 3.071.961,99 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/05/23: | | 3.221.716,53 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | |
| a) Ultimo año: | | 6,68% |
| b) Ultimo semestre: | | 8,07% |
| c) Ultimo trimestre: | | 9,05% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | | 0,67% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses: | | 0,00% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | | 36,65% |
| 7. Nivel de Impago (2) | | 0,32% |

(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 con morosidad superior a 90 días en la Fecha de Cobro inmediata anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

Destinatarios: Cedentes; CNMV; AIAF.



Nº: 2350/23
Titulización de Activos, (SGFT), S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.: 917020808
http://www.tda-sgft.com
TDA27Unfoinver.trimJun23

TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS (en proceso de liquidación)
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 28/03/23 - 28/06/23
I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|---|---|
| Fecha de Constitución del Fondo | 20 de diciembre de 2006 |
| Fecha Emisión Bonos | 20 de diciembre de 2006 |
| Fecha Final Amortización Bonos (6,68% TAA) | 28 de septiembre de 2029 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca | Bankia (Caja Granada), Caixabank (Credifimo) BBVA (Caixa Terrasa), Kutxa Bank (Caja Vital) |
| Agente de Pagos | BNP PARIBAS |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Fitch Ratings, Standard & Poor's |
| Calificación | Bono A3: (F) CCC (sf) / (S&P) NR Bono B: (F) C (sf) / (S&P) NR Bono C: (F) C (sf) / (S&P) NR Bono D: (F) C (sf) / (S&P) NR Bono E: (F) C (sf) / (S&P) NR Bono F: (F) C (sf) / (S&P) NR |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Nombre | Bonos de Titulización TDA 27 |
|---|------------------------------|
| Serie A3: | |
| Código ISIN | ES0377954021 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 181,300.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 131.780.642,63 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 72.686,51 Euros |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)

| Nombre | Bonos de Titulización TDA 27 |
|---|-------------------------------------|
| Serie B: | |
| Código ISIN | ES0377954039 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 13.900.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 13.900.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie C: | |
| Código ISIN | ES0377954047 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 9.300.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 9.300.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie D: | |
| Código ISIN | ES0377954054 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 14.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 14.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie E: | |
| Código ISIN | ES0377954062 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 14.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 14.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie F: | |
| Código ISIN | ES0377954070 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 600.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 600.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |

III. INFORMACION INCLUIDA

- * Liquidación del Período: 28/03/23 - 28/06/23
- * Flujos de Caja del Período: 28/03/23 - 28/06/23
- * Información a los inversores. Fecha de Pago: 28 de Junio de 2023

TDA 27 (en proceso de liquidación)**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 28/03/23 - 28/06/23**

| | Euros | |
|---|---------------------|---------------------|
| | Ingresos | Pagos |
| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | | |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 6.504.191,89 |
| Amortización Participaciones Hip. | 6.293.678,52 | |
| Amortización Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| Ingresos por venta de Inmueble | 287.797,01 | |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados línea de liquidez | | 65.074,52 |
| Intereses pagados a los BTH | | 1.136.170,84 |
| Intereses recibidos de las PHs | 1.313.024,38 | |
| Intereses Inversiones Temporales | 39.435,03 | |
| Intereses Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| III. DISPOSICIÓN LÍNEA DE LIQUIDEZ | 0,00 | |
| IV. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: | | 228.488,25 |
| Margen de Intermediación Financiera | | 0,00 |
| Total Ingresos/Pagos | 7.933.934,94 | 7.933.925,50 |
| Saldo inicial 28/03/23 | 1,91 | |
| A Inversiones Temporales | | 11,35 |
| Total | 7.933.936,85 | 7.933.936,85 |
| Retenciones practicadas el 28/06/23 | 215.872,46 | |
| A Inv. Temporales | | 215.872,46 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 2356/23**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA 27/flujo.trim/Jun23