

TDA 23 - Fondo de Titulización de Activos
LIQUIDACION DEL PERIODO 22/06/2021 AL 22/09/2021

	Euros
	Total
I. Situación al 22/06/21 :	5.160.000,00
Saldo inicial Fondo de Reserva	5.160.000,00
II. Fondos recibidos del emisor	3.298.914,57
Principal:	
Según calendario hasta 31/08/21:	2.279.173,69
Amort. Anticipada hasta 31/08/21:	848.223,41
Intereses:	171.517,47
III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):	8.458.914,57
IV. Total Intereses de la reinversión:	-10.907,04
Intereses de la Cta. De Tesorería	-3.716,82
Intereses de la Cta. De Cobros	-748,26
Intereses de la Cta. De Reinversión	-6.441,96
V. Recursos disponibles (III + IV):	8.448.007,53
VI. Gastos:	21.983,76
VII. Liquidación SWAP:	-141.227,96
Cantidad a Pagar por la Parte A (HSBC):	30.289,51
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	171.517,47
VIII. Pago a los Bonos:	3.197.497,16
Bonos A:	
Intereses correspondientes al 22/09/21:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 22/09/21:	3.195.424,96
Bonos B:	
Intereses correspondientes al 22/09/21:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 22/09/21:	0,00
Bonos C:	
Intereses correspondientes al 22/09/21:	2.072,20
Retenciones practicadas a los bonos:	-393,72
Amortización correspondiente al 22/09/21:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	393,72
IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII):	5.087.298,65
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva (22/06/21)	5.160.000,00
Aportación al Fondo de Reserva	-72.701,35
Intereses préstamo subordinado G.I. Pagados	0,00
Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada	0,00
Amortización préstamo subordinado G.I.	0,00
Amortización Préstamo Participativo	0,00
Remuneración Variable Prést. Participativo	0,00
Recursos aportados (-) / recibidos (+) para el Orden de Prelación de Pagos acumulado previo	0,00
Recursos aportados (-) / recibidos (+) para el Orden de Prelación de Pagos fecha de pago actual	0,00
Recursos aportados (-) / recibidos (+) para el Orden de Prelación de Pagos acumulado actual	0,00
Márgen devengado no cobrado (-) / recursos tomados en préstamo (+) acumulado previo	0,00
Márgen devengado no cobrado (-) / recursos tomados en préstamo (+) en fecha de pago actual	0,00
Márgen devengado no cobrado (-) / recursos tomados en préstamo (+) acumulado actual	0,00
Fondo de Reserva (22/09/21)	5.087.298,65

Destinatarios: CNMV, AIAF

TDA 23, FTA

INFORMACION A LOS INVERSORES FECHA DE PAGO: 22 de Septiembre de 2021

Importes en euros

I. BONOS A ES0377984002	Sobre 8372 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (23/03/05):	837.200.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	61.000.317,56 €	7.286,23 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	3.195.424,96 €	381,68 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	57.804.892,60 €	6.904,55 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	6,904550%	6,904550%

II. BONOS B ES0377984010	Sobre 163 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (23/03/05):	16.300.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	9.871.043,65 €	60.558,55 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	9.871.043,65 €	60.558,55 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	60,558550%	60,558550%

III. BONOS C ES0377984028	Sobre 65 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (23/03/05):	6.500.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	3.936.305,75 €	60.558,55 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	2.072,20 €	31,88 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	3.936.305,75 €	60.558,55 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	60,558550%	60,558550%

IV. EL FONDO	Importes en euros
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/08/21:	
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:	71.612.240,62 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:	3.847.692,05 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:	71.658.255,45 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:	6.343.705,08 €
2. Amortización del período 31/05/21 a 31/08/21:	
a) Según calendario:	2.279.173,69 €
b) Amortización anticipada hasta 31/08/21:	848.223,41 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):	
a) Ultimo año:	14,35%
b) Ultimo semestre:	11,94%
c) Ultimo trimestre:	4,46%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:	0,24%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:	0,21%
6. Porcentaje de fallidos (1):	8,13%
7. Nivel de Impago (2)	0,34%

(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: Cedente; CNMV.



Nº: 3430/21

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

TDA23\Infoinver.trim\Sep21

TDA 23, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 22/06/21-22/09/21
I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	18 de marzo de 2005
Fecha Emisión BTH	18 de marzo de 2005
Fecha Final Amortización BTH (14,35% TAA)	22 de diciembre de 2021
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca	Bco. Sabadell (Bco. Guipuzcoano) Banca March BBVA (C. Tarragona)
Agente de Pagos	Société Générale, Sucursal en España
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Moody's Investors Service España S.A
Calificación	Bono A: (M) Aa1 (sf) Bono B: (M) Aa2 (sf) Bono C: (M) Baa2(sf)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Nombre	Bonos de Titulización TDA 23
Serie A:	
Código ISIN	ES0377984002
Nominal en circulación total (inicial)	837.200.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	57.804.892,60 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	6.904,55 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0377984010
Nominal en circulación total (inicial)	16.300.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	9.871.043,65 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	60.558,55 Euros

TDA23\INFO.trim\Sep21

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)

Nombre	Bonos de Titulización TDA 23
Serie C:	
Código ISIN	ES0377984028
Nominal en circulación total (inicial)	6.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	3.936.305,75 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	60.558,55 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA

- * Liquidación del Período: 22/06/21-22/09/21
- * Flujos de Caja del Período: 22/06/21-22/09/21
- * Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Septiembre de 2021

TDA 23**Fondo de Titulización de Activos
FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/06/21 - 22/09/21**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip.		3.195.424,96
Amortización Participaciones Hip.	3.127.397,10	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		2.072,20
Intereses recibidos de las PHs	171.517,47	
Intereses Ptmos. Subordinados		0,00
Intereses Inversiones Temporales	-10.907,04	
III. GASTOS		
Comisiones y Gastos		21.983,76
Neto SWAP		141.227,96
Remuneración Variable Préstamo Participativo		0,00
Total Ingresos/Pagos	3.288.007,53	3.360.708,88
Saldo inicial 22/06/21	5.160.000,00	
A Inversiones Temporales		5.087.298,65
Total	8.448.007,53	8.448.007,53
Retenciones practicadas el 22/09/21	393,72	
A Inversiones Temporales		393,72

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 3438/21**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA23/flujo.trim/Sep21