

TDA SABADELL RMBS 4 - Fondo de Titulización

LIQUIDACION DEL PERIODO 27/11/23 - 26/02/24

	Euros
I. Situación al 27/11/23:	172.629.109,70
Saldo inicial Fondo de Reserva	172.629.109,70
II. Fondos recibidos del emisor	145.990.110,92
Principal:	
Según calendario hasta 31/01/24:	34.951.437,03
Amort. Anticipada hasta 31/01/24:	77.825.460,76
Intereses:	
Intereses regulares:	33.213.213,13
III. Subtotal Recursos disponibles (I + II):	318.619.220,62
IV. Total intereses de la reinversión:	2.779.357,94
Intereses de la cuenta de Tesorería	2.779.357,94
V. Recursos disponibles (III + IV):	321.398.578,56
VI. Gastos:	87.367,22
VII. Liquidación SWAP:	9.059.434,84
Cantidad a Pagar por la Parte A (Fondo):	33.213.213,13
Cantidad a Pagar por la Parte B (Banco Sabadell):	42.272.647,97
VIII. Pago a los Bonos:	151.068.480,00
BONOS A:	
Intereses correspondientes al 26/02/24:	32.093.472,00
Retenciones practicadas a los bonos:	6.097.759,68
Amortización correspondiente al 26/02/24:	112.338.555,00
BONOS B:	
Intereses correspondientes al 26/02/24:	6.636.453,00
Retenciones practicadas a los bonos:	1.260.926,07
Amortización correspondiente al 26/02/24:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	-7.358.685,75
IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII)	179.302.166,18
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo (27/11/23):	172.629.109,70
Aportación al Fondo de Reserva	-5.084.704,13
Intereses préstamo Participativo F.R.	1.275.554,58
Amortización préstamo Participativo F.R.	10.482.206,03
Otros Recursos para el siguiente pago	0,00
X. Comisión del Administrador de las CTH	0,00
Comisión impagada anterior fecha de pago	2.784.718,36
Comisión correspondiente al 26/02/24:	82.446,88
Comisión pagada el 26/02/24:	0,00
Comisión impagada a 26/02/24:	2.867.165,24
Margen de Intermediación Financiera	0,00
Fondo de Reserva 26/02/24:	167.544.405,57

Destinatarios: CNMV, AIAF



Nº: 780/24

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA SABADELL RMBS 4/liq.trim\Feb24

TDA SABADELL RMBS 4 - Fondo de Titulización**INFORMACION A LOS INVERSORES****FECHA DE PAGO: 26 de Febrero de 2024**

Importes en euros		
I. BONOS A ES0305299002	Sobre 54300 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (04/12/2017):	5.430.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	2.849.273.583,00 €	52.472,81 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	32.093.472,00 €	591,04 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	112.338.555,00 €	2.068,85 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	2.736.935.028,00 €	50.403,96 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	50,403960%	50,403960%

II. BONOS B ES0305299010	Sobre 5700 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (04/12/2017):	570.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	570.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	6.636.453,00 €	1.164,29 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	570.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

Importes en euros		
III. EL FONDO		
1. Saldo de préstamos a 31/01/24:		
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidos:		3.305.586.947,81 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidos:		40.264.985,66 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidos:		3.306.935.207,56 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidos:		42.239.011,82 €
2. Amortización del período de 31/10/23 a 31/01/24:		
a) Según calendario:		34.951.437,03 €
b) Amortización anticipada hasta 31/01/24:		77.825.460,76 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):		
a) Ultimo año:		8,10%
b) Ultimo semestre:		8,03%
c) Ultimo trimestre:		8,80%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:		1,24%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:		0,43%
6. Porcentaje de fallidos (1):		1,26%
7. Nivel de Impago (2)		0,95%

(1) Saldo pendiente de los Certificados Hipotecarios fallidos según definición del Folleto de Emisión (retraso de 12 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de los Certificados Hipotecarios 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 Certificados Hipotecarios.

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF.



Nº: 781/24

Titulización de Activos, (SGFT),S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA SABADELL RMBS 4\Infoinver.trim\Feb24

TDA SABADELL RMBS 4, FONDO DE TITULIZACION
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 27/11/23 - 26/02/24
I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	29 de noviembre de 2017
Fecha Emisión BT	4 de diciembre de 2017
Fecha Final Amortización Bonos (teórica) (8,10% TAA)	26 de noviembre de 2036
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias	Banco Sabadell
Agente de Pagos	Banco Sabadell
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Moody's Investors Service / DBRS
Calificación	Bonos A: (M) Aa1 (sf) / (D) AA (sf) Bonos B: (M) B3 (sf) / (D) BBB (sf)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Nombre	Bonos de Titulización TDA SABADELL RMBS 4
Serie A:	
Código ISIN	ES0305299002
Nominal en circulación total (inicial)	5.430.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	2.736.935.028,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	50.403,96 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0305299010
Nominal en circulación total (inicial)	570.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	570.000.000,00 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: 27/11/23 - 26/02/24
* Flujos de Caja del Período: 27/11/23 - 26/02/24
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 26 de Febrero de 2024

TDA SABADELL RMBS 4\INFO.trim\Feb24

TDA SABADELL RMBS 4 - Fondo de Titulización

FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 27/11/23 - 26/02/24

	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
I. INVERSIONES/FINANCIACIONES		
Amortización Bonos Titulización Hip.		112.338.555,00
Amortización Participaciones Hip.	112.776.897,79	
Amortización Ptmos. Subordinados		10.482.206,03
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		38.729.925,00
Intereses recibidos de las CTH	33.213.213,13	
Intereses Ptmos. Subordinados		1.275.554,58
Intereses Inversiones Temporales	2.779.357,94	
III. COMISIONES y GASTOS		
Comisiones y Gastos:		87.367,22
Neto SWAP	9.059.434,84	
Comisión del Administrador de las CTH		0,00
Margen de Intermediación Financiera		0,00
Total Ingresos/Pagos	157.828.903,70	162.913.607,83
Saldo inicial 27/11/23	172.629.109,70	
A Inversiones Temporales		167.544.405,57
Total	330.458.013,40	330.458.013,40
Retenciones practicadas el 26/02/24	7.358.685,75	
A Inversiones temporales		7.358.685,75

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 785/24

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA SABADELL RMBS 4\fluj.trim\Feb24