

TDA 20-MIXTO - Fondo de Titulización de Activos
LIQUIDACION DEL PERIODO 26/10/18 - 28/01/19

| | Euros | | |
|--|---------------------|---------------------|---------------------|
| | TOTAL GRUPO 1 | TOTAL GRUPO 2 | TOTAL FONDO |
| I. Situación al 26/10/18: | 3.855.537,18 | 2.031.030,94 | 5.886.568,12 |
| Saldo inicial Cta. Tesorería | 3.855.537,18 | 2.031.030,94 | 5.886.568,12 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 1.783.226,38 | 841.243,57 | 2.624.469,95 |
| Principal: | | | |
| Según calendario hasta 31/12/18: | 1.207.047,80 | 454.756,37 | 1.661.804,17 |
| Amort. Anticipada hasta 30/11/18: | 249.358,82 | 143.017,35 | 392.376,17 |
| Amort. Anticipada último mes: | 212.296,50 | 170.579,24 | 382.875,74 |
| Intereses: | 117.097,03 | 71.090,74 | 188.187,77 |
| Avance técnico neto (1): | -2.573,77 | 1.799,87 | -773,90 |
| III. Subtotal a Cuenta de reinversión (I + II): | 5.638.763,56 | 2.872.274,51 | 8.511.038,07 |
| IV. Intereses de las Cuentas del Fondo: | -4.683,08 | -2.352,49 | -7.035,57 |
| Intereses Cta. Tesorería | -4.683,08 | -2.352,49 | -7.035,57 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 5.634.080,48 | 2.869.922,02 | 8.504.002,50 |
| VI. Varios: | 16.513,10 | 7.214,92 | 23.728,02 |
| VII. Liquidación SWAP: | -40.100,25 | -27.829,25 | -67.929,50 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (JP Morgan) | -27.691,18 | -11.611,93 | -39.303,11 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo) | 12.409,07 | 16.217,32 | 28.626,39 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 1.479.122,70 | 606.167,04 | 2.085.289,74 |
| Bonos A1: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/01/19: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 28/01/19: | 1.476.379,03 | 0,00 | 1.476.379,03 |
| Bonos B1: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/01/19: | 2.743,67 | 0,00 | 2.743,67 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 521,30 | 0,00 | 521,30 |
| Amortización correspondiente al 28/01/19: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Bonos A2: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/01/19: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 28/01/19: | 0,00 | 599.839,68 | 599.839,68 |
| Bonos B2: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/01/19: | 0,00 | 6.327,36 | 6.327,36 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 | 1.202,20 | 1.202,20 |
| Amortización correspondiente al 28/01/19: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Reinversión de las retenciones: | -521,30 | -1.202,20 | -1.723,50 |
| IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII): | 4.098.344,43 | 2.228.710,81 | 6.327.055,24 |
| Distribución del saldo disponible: | | | |
| Fondo de Reserva a 26/10/18: | 3.812.500,00 | 2.030.000,00 | 5.842.500,00 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Otros recursos disponibles | 211.517,06 | 171.581,67 | 383.098,73 |
| Intereses pagados Préstamo Participativo | 4.061,67 | 2.345,16 | 6.406,83 |
| Amortización Préstamo Participativo | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Remuneración variable prést.participativo | 70.265,70 | 24.783,98 | 95.049,68 |
| Fondo de Reserva a 28/01/19: | 3.812.500,00 | 2.030.000,00 | 5.842.500,00 |
| (1) Avance técnico solicitado: | -2.573,77 | 1.799,87 | -773,90 |
| Trimestre anterior | 18.997,51 | 9.042,81 | 28.040,32 |
| Trimestre actual | 16.423,74 | 10.842,68 | 27.266,42 |
| Importe préstamos fallidos del período: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Principal vencido y no cobrado superior a 1 mes e inferior a 12 meses: | -2.660,40 | 1.474,47 | -1.185,93 |
| Trimestre anterior | 5.044,90 | 2.034,10 | 7.079,00 |
| Trimestre actual | 2.384,50 | 3.508,57 | 5.893,07 |

Destinatarios: CNMV, AIAF



Nº: 225/19

Titulización de Activos, (SGFT),S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.:917020808
<http://www.tda-sgft.com>
TDA20\liq.trim\Ene19

TDA 20 - MIXTO

Fondo de Titulización de Activos

INFORMACION A LOS INVERSORES**FECHA DE PAGO: 28 de enero de 2019**

Importes en euros

| I. BONOS A1 ES0377981008 | Sobre 2971 bonos | Por Bono |
|---|-------------------------|-----------------|
| 1. Saldo inicial (30/06/04): | 297.100.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 32.812.763,85 € | 11.044,35 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 1.476.379,03 € | 496,93 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 31.336.384,82 € | 10.547,42 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 10,547420% | 10,547420% |

| II. BONOS B1 ES0377981016 | Sobre 79 bonos | Por Bono |
|---|-----------------------|-----------------|
| 1. Saldo inicial (30/06/04): | 7.900.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 7.900.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 2.743,67 € | 34,73 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 7.900.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |

| III. BONOS A2 ES0377981024 | Sobre 1056 bonos | Por Bono |
|---|-------------------------|-----------------|
| 1. Saldo inicial (30/06/04): | 105.600.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 8.129.425,92 € | 7.698,32 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 599.839,68 € | 568,03 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 7.529.586,24 € | 7.130,29 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 7,130290% | 7,130290% |

| IV. BONOS B2 ES0377981032 | Sobre 104 bonos | Por Bono |
|---|------------------------|-----------------|
| 1. Saldo inicial (30/06/04): | 10.400.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 10.400.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 6.327,36 € | 60,84 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 10.400.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |

| V. EL FONDO | Importes en euros | |
|--|--------------------------|-----------------|
| | GRUPO 1 | GRUPO 2 |
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/12/18: | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | 39.024.875,35 € | 17.757.999,64 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas: | 342.793,70 € | 21.391,04 € |
| c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | 39.041.972,89 € | 17.771.275,87 € |
| d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas: | 630.108,67 € | 32.643,53 € |
| 2. Amortización del período 30/09/18 a 31/12/18: | 1.668.703,12 € | 768.352,96 € |
| a) Según calendario: | 1.207.047,80 € | 454.756,37 € |
| b) Amortización anticipada hasta 30/11/18: | 249.358,82 € | 143.017,35 € |
| c) Amortización anticipada del 30/11/18 a 31/12/18: | 212.296,50 € | 170.579,24 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | |
| b) Último año: | 4,13% | 3,64% |
| c) Último semestre: | 4,62% | 4,28% |
| d) Último trimestre: | 4,46% | 6,60% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | 0,13% | 0,68% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses: | 0,00% | 0,00% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | 1,59% | 0,18% |
| 7. Nivel de Impago(2): | 0,00% | 0,00% |

(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; Agente de Pagos; CNMV; AIAF.



Nº: 226/19

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

TDA20\Infoinver.trim\Ene19

TDA 20-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 26/10/18 - 28/01/19
I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|---|---|
| Fecha de Constitución del Fondo | 25 de junio de 2004 |
| Fecha Emisión BTH | 25 de junio de 2004 |
| Fecha Final Amortización BTH (4,13% TAA Grupo 1 / 3,64% TAA Grupo 2) | 26 de octubre de 2021 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT, S.A. |
| Emisores Participaciones Hipotecarias | Bankia (Sa Nostra) BBVA (C. Manlleu) Banco Caminos Caja Ingenieros |
| Agente de Pagos | Société Générale, Sucursal en España |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Moody's Investors Service España S.A |
| Calificación | Bono A1: (M) Aa1 (sf) Bono B1: (M) Aa3 (sf) Bono A2: (M) Aa1 (sf) Bono B2: (M) A1 (sf) |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Nombre | Bonos de Titulización TDA 20-MIXTO |
|---|------------------------------------|
| Serie A1: | |
| Código ISIN | ES0377981008 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 297.100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 31.336.384,82 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 10.547,42 Euros |
| Serie B1: | |
| Código ISIN | ES 0377981016 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 7.900.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 7.900.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |

TDA 20 MIXTO\INFO.trim\Ene19

| II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.) | |
|--|---|
| Nombre | Bonos de Titulización TDA 20-MIXTO |
| Serie A2: | |
| Código ISIN | ES 0377981024 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 105.600.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 7.529.586,24 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 7.130,29 Euros |
| Serie B2: | |
| Código ISIN | ES 0377981032 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 10.400.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 10.400.000,00 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: 26/10/18 - 28/01/19 |
| * Flujos de Caja del Período: 26/10/18 - 28/01/19 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 28 de Enero de 2019 |

TDA 20-MIXTO

Fondo de Titulización de Activos

FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 26/10/18 - 28/01/19

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | Euros | |
|---|---------------------|---------------------|
| | Ingresos | Pagos |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 2.076.218,71 |
| Amortización Participaciones Hip. | 2.437.056,08 | |
| Amortización Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 9.071,03 |
| Intereses recibidos de las PHs | 188.187,77 | |
| Intereses Ptmo. Subordinado | | 6.406,83 |
| Intereses Inversiones Temporales | -7.035,57 | |
| Avance Técnico Neto | | 773,90 |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: | | 23.728,02 |
| Neto Swap | | 67.929,50 |
| Remuneración variable del Préstamo Participativo | | 95.049,68 |
| IV. INTERESES PAGADOS POR RECURSOS PRESTADOS | | 0,00 |
| Total Ingresos/Pagos | 2.618.208,28 | 2.279.177,67 |
| Saldo inicial 26/10/18 | 5.886.568,12 | |
| A Inversiones Temporales | | 6.225.598,73 |
| Total | 8.504.776,40 | 8.504.776,40 |
| Retenciones practicadas el 28/01/19 | 1.723,50 | |
| A Inv.Temporales | | 1.723,50 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 232/19

Titulización de Activos, (SGFT),S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA20fluj.trimEne19