

TDA 20-MIXTO - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 26/07/17 - 26/10/17

	Euros		
	TOTAL GRUPO 1	TOTAL GRUPO 2	TOTAL FONDO
I. Situación al 26/07/17:	4.013.118,66	2.105.773,80	6.118.892,46
Saldo inicial Cta. Tesorería	4.013.118,66	2.105.773,80	6.118.892,46
II. Fondos recibidos del emisor	1.989.838,42	639.611,96	2.629.450,38
Principal:			
Según calendario hasta 30/09/17:	1.345.369,03	468.894,27	1.814.263,30
Amort. Anticipada hasta 31/08/17:	332.444,67	38.590,92	371.035,59
Amort. Anticipada último mes:	164.435,58	47.849,89	212.285,47
Intereses:	149.027,86	84.076,02	233.103,88
Avance técnico neto (1):	-1.438,72	200,86	-1.237,86
III. Subtotal a Cuenta de reinversión (I + II):	6.002.957,08	2.745.385,76	8.748.342,84
IV. Intereses de Reinversión:	-5.013,97	-2.435,42	-7.449,39
Intereses Cta. Tesorería	-5.013,97	-2.435,42	-7.449,39
V. Recursos disponibles (III + IV):	5.997.943,11	2.742.950,34	8.740.893,45
VI. Varios:	19.693,67	7.435,38	27.129,05
VII. Liquidación SWAP:	-57.740,65	-35.989,98	-93.730,63
Cantidad a Pagar por la Parte A (JP Morgan)	-34.022,59	-13.619,35	-47.641,94
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo)	23.718,06	22.370,63	46.088,69
VIII. Pago a los Bonos:	1.821.348,30	585.089,92	2.406.438,22
Bonos A1:			
Intereses correspondientes al 26/10/17:	0,00	0,00	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00	0,00	0,00
Amortización correspondiente al 26/10/17:	1.818.905,62	0,00	1.818.905,62
Bonos B1:			
Intereses correspondientes al 26/10/17:	2.442,68	0,00	2.442,68
Retenciones practicadas a los bonos:	464,11	0,00	464,11
Amortización correspondiente al 26/10/17:	0,00	0,00	0,00
Bonos A2:			
Intereses correspondientes al 26/10/17:	0,00	0,00	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00	0,00	0,00
Amortización correspondiente al 26/10/17:	0,00	579.216,00	579.216,00
Bonos B2:			
Intereses correspondientes al 26/10/17:	0,00	5.873,92	5.873,92
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00	1.116,04	1.116,04
Amortización correspondiente al 26/10/17:	0,00	0,00	0,00
Reinversión de las retenciones:	-464,11	-1.116,04	-1.580,15
IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII):	4.099.160,49	2.114.435,06	6.213.595,55
Distribución del saldo disponible:			
Fondo de Reserva a 26/07/17:	3.869.203,85	2.030.000,00	5.899.203,85
Aportación al Fondo de Reserva	-26.332,32	0,00	-26.332,32
Otros recursos disponibles	162.689,96	54.397,16	217.087,12
Intereses pagados Préstamo Participativo	4.114,10	2.254,93	6.369,03
Amortización Préstamo Participativo	23.040,16	0,00	23.040,16
Remuneración variable prést.participativo	66.444,74	27.782,97	94.227,71
Fondo de Reserva a 26/10/17:	3.842.871,53	2.030.000,00	5.872.871,53
(1) Avance técnico solicitado:	-1.438,72	200,86	-1.237,86
Trimestre anterior	9.874,08	1.939,21	11.813,29
Trimestre actual	8.435,36	2.140,07	10.575,43
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:	-575,85	723,36	147,51
Trimestre anterior	7.044,14	848,96	7.893,10
Trimestre actual	6.468,29	1.572,32	8.040,61

Destinatarios: CNMV, AIAF



Nº: 4764/17

Titulización de Activos, (SGFT),S.A.
 Orense, 58
 28020 Madrid
 Tel.:917020808
<http://www.tda-sgft.com>
 TDA20liq.trimOct17

TDA 20 - MIXTO

Fondo de Titulización de Activos
INFORMACION A LOS INVERSORES
FECHA DE PAGO: 26 de octubre de 2017

I. BONOS A1 ES0377981008	Importes en euros	
	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:	41.803.812,02 €	14.070,62 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	1.818.905,62 €	612,22 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	39.984.906,40 €	13.458,40 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	13,458400%	13,458400%

II. BONOS B1 ES0377981016	Importes en euros	
	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:	2.442,68 €	30,92 €
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	Importes en euros	
	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:	11.247.107,52 €	10.650,67 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	579.216,00 €	548,50 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	10.667.891,52 €	10.102,17 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	10,102170%	10,102170%

IV. BONOS B2 ES0377981032	Importes en euros	
	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:	5.873,92 €	56,48 €
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 30/09/17:		
a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas:	47.726.291,51 €	21.015.236,01 €
b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas:	514.412,11 €	30.304,15 €
c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas:	47.740.353,32 €	21.018.644,56 €
d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas:	636.409,06 €	32.643,53 €
2. Amortización del período 30/06/17 a 30/09/17:	1.842.249,28 €	555.335,08 €
a) Según calendario:	1.345.369,03 €	468.894,27 €
b) Amortización anticipada hasta 31/08/17:	332.444,67 €	38.590,92 €
c) Amortización anticipada del 31/08/17 a 30/09/17:	164.435,58 €	47.849,89 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):		
b) Ultimo año:	4,73%	2,44%
c) Ultimo semestre:	3,26%	2,74%
d) Ultimo trimestre:	3,95%	1,59%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:	0,21%	0,41%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:	0,00%	0,00%
6. Porcentaje de fallidos (1):	1,32%	0,16%
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: 4765/17

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.: 917020808
http://www.tda-sgft.com
TDA20\Infoinver.trim\Oct17

TDA 20-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 26/07/17 - 26/10/17
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 (4,73% TAA Grupo 1 / 2,44% TAA Grupo 2)	26 de enero de 2022
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias	Banco Mare Nostrum (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) Aa2 (sf) Bono B1: (M) A3 (sf) Bono A2: (M) Aa2 (sf) Bono B2: (M) A2 (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)	39.984.906,40 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	13.458,40 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\Oct17

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)	10.667.891,52 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	10.102,17 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: 26/07/17 - 26/10/17
* Flujos de Caja del Período: 26/07/17 - 26/10/17
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 26 de Octubre de 2017

TDA 20-MIXTO*Fondo de Titulización de Activos***FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 26/07/17 - 26/10/17**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip.		2.398.121,62
Amortización Participaciones Hip.	2.397.584,36	
Amortización Ptmos. Subordinados		23.040,16
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		8.316,60
Intereses recibidos de las PHs	233.103,88	
Intereses Ptmo. Subordinado		6.369,03
Intereses Inversiones Temporales	-7.449,39	
Avance Técnico Neto		1.237,86
III. GASTOS		
Comisiones Periódicas:		27.129,05
Neto Swap		93.730,63
Remuneración variable del Préstamo Participativo		94.227,71
IV. INTERESES PAGADOS POR RECURSOS PRESTADOS		0,00
Total Ingresos/Pagos	2.623.238,85	2.652.172,66
Saldo inicial 26/07/17	6.118.892,46	
A Inversiones Temporales		6.089.958,65
Total	8.742.131,31	8.742.131,31
Retenciones practicadas el 26/10/17	1.580,15	
A Inv.Temporales		1.580,15

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 4771/17**

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA20fluju.trimOct17