

## FTPME ICO- TDA2

**INFORMACION CORRESPONDIENTE AL MES DE SEPTIEMBRE DE 2001**  
**INFORMATION CORRESPONDING TO THE MONTH OF SEPTEMBER 2001**

La Sociedad Gestora informa de los siguientes conceptos:  
*The Sociedad Gestora provides the following information:*

*	Saldo Vivo de Derechos de Crédito a 01/09/01: <i>Outstanding Balance of the Credit Rights on 01/09/01:</i>	<b>238.465.968,22 Euros</b> (39.677.398.588 Ptas)
*	Saldo Vivo de Derechos de Crédito a 30/09/01: <i>Outstanding Balance of the Credit Rights on 30/09/01:</i>	<b>234.357.926,98 Euros</b> (38.993.878.039 Ptas)
*	Tasa <sup>(1)</sup> de Amortización Anticipada (TAA) correspondiente al mes de Septiembre: <i>Prepayment Rate<sup>(1)</sup> corresponding to the month of September:</i>	0,47%
*	TAA (desde el 02/03/01): <i>CPR (since 02/03/01):</i>	1,43%
*	Vida Media bonos (TAA 5%) / Average Life of bonds (CPR 5%)	
	- Bonos 1CA / <i>Bonds 1CA:</i>	1,96
	- Bonos 1SA / <i>Bonds 1SA:</i>	1,96
	- Bonos 2CA / <i>Bonds 2CA:</i>	4,11
	- Bonos 2SA / <i>Bonds 2SA:</i>	4,11
	- Bonos B / <i>Bonds B:</i>	4,11

La Sociedad Gestora, para facilitar a los inversores la valoración de los Bonos, suministra a demanda los flujos de pago previstos durante la vida del Bono, bajo diversas hipótesis alternativas de TAA.

*In order to facilitate the evaluation of the Bonds for the investors, the Sociedad Gestora will supply upon request the projected cashflows for the life of the Bond, under different prepayment scenarios.*

Fecha / Date: 26/10/01

<sup>(1)</sup> Tasa Anualizada

<sup>(1)</sup> Annualized Rate