

TDA IBERCAJA 4 - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 26/08/20 - 26/11/20

| | Euros |
|--|----------------------|
| I. Situación al 26/08/20: | 7.000.000,00 |
| Saldo inicial Cta. Reinversión | 7.000.000,00 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 11.995.378,52 |
| Principal: | |
| Según calendario hasta 31/10/20: | 8.017.121,32 |
| Amort. Anticipada hasta 31/10/20: | 3.564.898,39 |
| Intereses: | 413.358,81 |
| III. Subtotal a Cuenta de reinversión (I + II): | 18.995.378,52 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | -18.213,35 |
| Intereses de la Cta. De Reinversión | -17.932,23 |
| Intereses Cta. Tesorería. | -281,12 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 18.977.165,17 |
| VI. Varios: | 34.812,43 |
| VII. Liquidación SWAP: | -279.276,96 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (Fondo): | 413.358,81 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Banco Santander): | 134.081,85 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 11.183.191,15 |
| Bonos A1: | |
| Intereses correspondientes al 26/11/20: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 26/11/20: | 2.950.850,00 |
| Bonos A2: | |
| Intereses correspondientes al 26/11/20: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 26/11/20: | 6.885.336,26 |
| Bonos B: | |
| Intereses correspondientes al 26/11/20: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 26/11/20: | 280.043,40 |
| Bonos C: | |
| Intereses correspondientes al 26/11/20: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 26/11/20: | 560.086,80 |
| Bonos D: | |
| Intereses correspondientes al 26/11/20: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 26/11/20: | 254.175,04 |
| Bonos E: | |
| Intereses correspondientes al 26/11/20: | 18.234,30 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -3.464,52 |
| Amortización correspondiente al 26/11/20: | 176.111,60 |
| Bonos F: | |
| Intereses correspondientes al 26/11/20: | 58.353,75 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -11.087,21 |
| Amortización correspondiente al 26/11/20: | 0,00 |
| Reinversión o devolución de las retenciones: | 14.551,73 |
| IX. Saldo disponible (V- VI + VII - VIII): | 7.479.884,63 |
| Distribución del saldo disponible: | |
| Fondo de Reserva 26/08/20: | 7.000.000,00 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 0,00 |
| Margen de intermediación financiera | 479.884,63 |
| Fondo de Reserva 26/11/20: | 7.000.000,00 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 4379/20

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.:917020808
<http://www.tda-sgft.com>
TDAIBERCAJA4liq.trim|Nov20

TDA IBERCAJA 4

Fondo de Titulización de Activos

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 26 de Noviembre de 2020

| Importes en euros | | | |
|---|--------------------------|-------------------------|------------------|
| I. BONOS A1 | ES0338453006 | Sobre 2500 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (23/10/06): | 250.000.000,00 € | | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 13.848.050,00 € | | 5.539,22 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 2.950.850,00 € | | 1.180,34 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 10.897.200,00 € | | 4.358,88 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 4,358880% | | 4,358880% |
| II. BONOS A2 | ES0338453014 | Sobre 8194 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (23/10/06): | 819.400.000,00 € | | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 268.378.655,58 € | | 32.753,07 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 6.885.336,26 € | | 840,29 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 261.493.319,32 € | | 31.912,78 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 31,912780% | | 31,912780% |
| III. BONOS B | ES0338453030 | Sobre 140 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (23/10/06): | 14.000.000,00 € | | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 8.035.245,40 € | | 57.394,61 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 280.043,40 € | | 2.000,31 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 7.755.202,00 € | | 55.394,30 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 55,394300% | | 55,394300% |
| IV. BONOS C | ES0338453048 | Sobre 280 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (23/10/06): | 28.000.000,00 € | | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 16.070.490,80 € | | 57.394,61 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 560.086,80 € | | 2.000,31 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 15.510.404,00 € | | 55.394,30 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 55,394300% | | 55,394300% |
| V. BONOS D | ES0338453055 | Sobre 112 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (23/10/06): | 11.200.000,00 € | | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 7.293.009,92 € | | 65.116,16 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 254.175,04 € | | 2.269,42 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 7.038.834,88 € | | 62.846,74 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 62,846740% | | 62,846740% |
| VI. BONOS E | ES0338453063 | Sobre 70 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (23/10/06): | 7.000.000,00 € | | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 5.053.148,80 € | | 72.187,84 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 18.234,30 € | | 260,49 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 176.111,60 € | | 2.515,88 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 4.877.037,20 € | | 69.671,96 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 69,671960% | | 69,671960% |
| VII. BONOS F | ES0338453071 | Sobre 105 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (23/10/06): | 10.500.000,00 € | | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 7.000.000,35 € | | 66.666,67 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 58.353,75 € | | 555,75 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 7.000.000,35 € | | 66.666,67 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 66,666670% | | 66,666670% |
| VIII. EL FONDO | Importes en euros | | |
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/10/20: | | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas: | | | 307.572.043,96 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas: | | | 3.844.434,91 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas: | | | 307.901.927,15 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidas: | | | 6.447.493,09 € |
| 2. Amortización del periodo 31/07/20 a 31/10/20: | | | 11.582.019,71 € |
| a) Según calendario: | | | 8.017.121,32 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/10/20: | | | 3.564.898,39 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | | |
| a) Ultimo año: | | | 3,46% |
| b) Ultimo semestre: | | | 3,75% |
| c) Ultimo trimestre: | | | 4,40% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | | | 0,48% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 17 meses: | | | 0,47% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | | | 2,05% |
| 7. Nivel de Impago (2) | | | 0,55% |

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 18 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; AIAF.



Nº: 4380/20

Orense, 58
28020 Madrid
Tel.: 917020808

<http://www.tda-sgft.com>
TDAIBERCAJA4InfoInver.trimNov20

TDA IBERCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 26/08/20 - 26/11/20
I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|---|---|
| Fecha de Constitución del Fondo | 18 de octubre de 2006 |
| Fecha Emisión Bonos | 18 de octubre de 2006 |
| Fecha Final Amortización Bonos (3,46% TAA) | 26 de febrero de 2026 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisores Participaciones Hipotecarias y CTH | IBERCAJA BANCO |
| Agente de Pagos | Societe Generale |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Moody's / Standard & Poor's |
| Calificación | Bonos A1: Aa1 (sf) (M) / AA+ (sf) (S&P) Bonos A2: Aa1 (sf) (M) / A+ (sf) (S&P) Bonos B: A1 (sf) (M) / BBB+ (sf) (S&P) Bonos C: Baa2 (sf) (M) / BB+ (sf) (S&P) Bonos D: B1 (sf) (M) / BB+ (sf) (S&P) Bonos E: Caa1 (sf) (M) / BB (sf) (S&P) Bonos F: - (sf) (M) / D (sf) (S&P) |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Nombre | Bonos de Titulización TDA IBERCAJA 4 |
|---|--------------------------------------|
| Serie A1: | |
| Código ISIN | ES0338453006 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 250.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 10.897.200,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 4.358,88 Euros |
| Serie A2: | |
| Código ISIN | ES0338453014 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 819.400.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 261.493.319,32 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 31.912,78 Euros |

| II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.) | |
|---|--------------------------------------|
| Nombre | Bonos de Titulización TDA IBERCAJA 4 |
| Serie B: | |
| Código ISIN | ES0338453030 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 14.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 7.755.202,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 55.394,30 Euros |
| Serie C: | |
| Código ISIN | ES0338453048 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 28.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 15.510.404,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 55.394,30 Euros |
| Serie D: | |
| Código ISIN | ES0338453055 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 11.200.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 7.038.834,88 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 62.846,74 Euros |
| Serie E: | |
| Código ISIN | ES0338453063 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 7.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 4.877.037,20 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 69.671,96 Euros |
| Serie F: | |
| Código ISIN | ES0338453071 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 10.500.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 7.000.000,35 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 66.666,67 Euros |

| III. INFORMACION INCLUIDA |
|--|
| * Liquidación del Período: 26/08/20 - 26/11/20 |
| * Flujos de Caja del Período: 26/08/20 - 26/11/20 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 26 de Noviembre de 2020 |

TDA IBERCAJA 4**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 26/08/20 - 26/11/20:**

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | Euros | |
|---|--------------------------|---------------------------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| Amortización Bonos Titulización Hip. Amortización Participaciones Hip. | 11.582.019,71 | 11.106.603,10 |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH Intereses recibidos de las PHs Intereses Inversiones Temporales | 413.358,81 -18.213,35 | 76.588,05 |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: Neto SWAP a favor de la Parte B Margen de intermediación financiera | | 34.812,43 279.276,96 479.884,63 |
| Total Ingresos/Pagos | 11.977.165,17 | 11.977.165,17 |
| Saldo inicial 26/08/20 A Inversiones Temporales | 7.000.000,00 | 7.000.000,00 |
| Total | 18.977.165,17 | 18.977.165,17 |
| Retenciones practicadas el 26/11/20 A inversiones temporales | 14.551,73 | 14.551,73 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 4386/20**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDAIBERCAJA4\fluj.trim\Nov20