

TDA 22, FTA

INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL MES DE SEPTIEMBRE DE 2023 INFORMATION CORRESPONDING TO THE MONTH OF SEPTEMBER 2023

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

*	Saldo vivo de derechos de crédito grupo 1 a 01/09/2023: Outstanding balance of the credit rights group 1 on 01/09/2023:	12.725.869,35 €
*	Saldo vivo de derechos de crédito grupo 1 a 30/09/2023: Outstanding balance of the credit rights group 1 on 30/09/2023:	12.567.138,58 €
*	Saldo vivo de derechos de crédito grupo 2 a 01/09/2023: Outstanding balance of the credit rights group 2 on 01/09/2023:	26.073.356,53 €
*	Saldo vivo de derechos de crédito grupo 2 a 30/09/2023: Outstanding balance of the credit rights group 2 on 30/09/2023:	25.781.094,84 €
*	Grupo 1: Tasa(1) de Amortización Anticipada(TAA) correspondiente al mes de Septiembre: Group 1: Prepayment Rate(1) corresponding to the month of September:	6,16 %
*	TAA grupo 1 (12 meses) / CPR group 1 (12 months):	6,74 %
*	Tipo interés medio ponderado grupo 1 / Weighted average interest rate group 1:	4,45 %
*	Vencimiento residual medio grupo 1 / Weighted average maturity group 1:	8,41
*	Grupo 2: Tasa(1) de Amortización Anticipada(TAA) correspondiente al mes de Septiembre: Group 2: Prepayment Rate(1) corresponding to the month of September:	4,69 %
*	TAA grupo 2 (12 meses) / CPR group 2 (12 months):	5,95 %
*	Tipo interés medio ponderado grupo 2 / Weighted average interest rate group 2:	3,80 %
*	Vencimiento residual medio grupo 2 / Weighted average maturity group 2:	11,11
*	Vida Media de los bonos Grupo 1 (TAA 6,74%) / Average Life of bonds Group 1 (CPR 6,74%):	
	-Bono-A1a / Bond-A1a	0,00
	-Bono-A1b / Bond-A1b	0,19
	-Bono-B1 / Bond-B1	0,19
	-Bono-C1 / Bond-C1	0,19
	-Bono-D1 / Bond-D1	0,19
	-Valor IO1 / Value IO1	0,00
*	Vida Media de los bonos Grupo 2 (TAA 5,95%) / Average Life of bonds Group 2 (CPR 5,95%):	
	-Bono-A2a / Bond-A2a	0,00
	-Bono-A2b / Bond-A2b	0,19
	-Bono-B2 / Bond-B2	0,19
	-Bono-C2 / Bond-C2	0,19
	-Bono-D2 / Bond-D2	0,19
	-Valor IO2 / Value IO2	0,00
*	Calificación Actual de los bonos / Current rating:	
	-Bono-A1a / Bond-A1a	(M) A3
	-Bono-A1b / Bond-A1b	(M) Aa1
	-Bono-B1 / Bond-B1	(M) Baa3
	-Bono-C1 / Bond-C1	(M) Caa3
	-Bono-D1 / Bond-D1	(M) Ca
	-Valor IO1 / Value IO1	(M) Aaa
	-Bono-A2a / Bond-A2a	(M) Aa2
	-Bono-A2b / Bond-A2b	(M) Aa1

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.

(1) Tasa Anualizada

(1) Annualized Rate

* Calificación Actual de los bonos / Current rating:
-Bono-B2 / Bond-B2
-Bono-C2 / Bond-C2
-Bono-D2 / Bond-D2
-Valor IO2 / Value IO2

(M) Aa1
(M) Aa2
(M) B1
(M) Aaa

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.

(1) Tasa Anualizada

(1) Annualized Rate

TDA22\Info.mensual\Sep23