

TDA 20-MIXTO, FTA

INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL MES DE OCTUBRE DE 2020 INFORMATION CORRESPONDING TO THE MONTH OF OCTOBER 2020

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

*	Saldo vivo de derechos de crédito grupo 1 a 01/10/2020: Outstanding balance of the credit rights group 1 on 01/10/2020:	29.030.442,71 €
*	Saldo vivo de derechos de crédito grupo 1 a 31/10/2020: Outstanding balance of the credit rights group 1 on 31/10/2020:	28.627.966,59 €
*	Saldo vivo de derechos de crédito grupo 2 a 01/10/2020: Outstanding balance of the credit rights group 2 on 01/10/2020:	13.714.731,13 €
*	Saldo vivo de derechos de crédito grupo 2 a 31/10/2020: Outstanding balance of the credit rights group 2 on 31/10/2020:	13.580.669,33 €
*	Grupo 1: Tasa(1) de Amortización Anticipada(TAA) correspondiente al mes de Octubre: Group 1: Prepayment Rate(1) corresponding to the month of October:	3,62 %
*	TAA grupo 1 (12 meses) / CPR group 1 (12 months):	4,09 %
*	Tipo interés medio ponderado grupo 1 / Weighted average interest rate group 1:	1,04 %
*	Vencimiento residual medio grupo 1 / Weighted average maturity group 1:	9,47
*	Grupo 2: Tasa(1) de Amortización Anticipada(TAA) correspondiente al mes de Octubre: Group 2: Prepayment Rate(1) corresponding to the month of October:	0,35 %
*	TAA grupo 2 (12 meses) / CPR group 2 (12 months):	1,75 %
*	Tipo interés medio ponderado grupo 2 / Weighted average interest rate group 2:	1,46 %
*	Vencimiento residual medio grupo 2 / Weighted average maturity group 2:	9,77
*	Vida Media de los bonos Grupo 1 (TAA 4,09%) / Average Life of bonds Group 1 (CPR 4,09%):	
	-Bono A1 / Bond A1	0,18
	-Bono B1 / Bond B1	0,18
*	Vida Media de los bonos Grupo 2 (TAA 1,75%) / Average Life of bonds Group 2 (CPR 1,75%):	
	-Bono A2 / Bond A2	0,18
	-Bono B2 / Bond B2	0,18
*	Calificación Actual de los bonos / Current rating:	
	-Bono A1 / Bond A1	(M) Aa1
	-Bono B1 / Bond B1	(M) Aa3
	-Bono A2 / Bond A2	(M) Aa1
	-Bono B2 / Bond B2	(M) A1

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