

TDA 26 MIXTO, FTA

INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL MES DE ENERO DE 2020 INFORMATION CORRESPONDING TO THE MONTH OF JANUARY 2020

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

*	Saldo pendiente de vencer de derechos de crédito no fallidos derivados de contratos de préstamo para la adquisición de vehículos grupo 1 a 01/01/2020: Outstanding Balance not due of credit rights arising from vehicle loan group 1 on 01/01/2020:	112.687.311,63 €
*	Saldo pendiente de vencer de derechos de crédito no fallidos derivados de contratos de préstamo para la adquisición de vehículos grupo 1 a 31/01/2020: Outstanding Balance not due of credit rights arising from vehicle loan group 1 on 31/01/2020:	111.436.865,66 €
*	Saldo pendiente de vencer de derechos de crédito no fallidos derivados de contratos de préstamo para la adquisición de vehículos grupo 2 a 01/01/2020: Outstanding Balance not due of credit rights arising from vehicle loan group 2 on 01/01/2020:	23.614.905,42 €
*	Saldo pendiente de vencer de derechos de crédito no fallidos derivados de contratos de préstamo para la adquisición de vehículos grupo 2 a 31/01/2020: Outstanding Balance not due of credit rights arising from vehicle loan group 2 on 31/01/2020:	23.463.406,65 €
*	Grupo 1: Tasa(1) de Amortización Anticipada(TAA) correspondiente al mes de Enero: Group 1: Prepayment Rate(1) corresponding to the month of January:	3,34 %
*	TAA grupo 1 (12 meses) / CPR group 1 (12 months):	5,23 %
*	Tipo interés medio ponderado grupo 1 / Weighted average interest rate group 1:	1,00 %
*	Vencimiento residual medio grupo 1 / Weighted average maturity group 1:	12,00
*	Grupo 2: Tasa(1) de Amortización Anticipada(TAA) correspondiente al mes de Enero: Group 2: Prepayment Rate(1) corresponding to the month of January:	0,25 %
*	TAA grupo 2 (12 meses) / CPR group 2 (12 months):	2,72 %
*	Tipo interés medio ponderado grupo 2 / Weighted average interest rate group 2:	0,63 %
*	Vencimiento residual medio grupo 2 / Weighted average maturity group 2:	14,10
*	Vida Media de los bonos Grupo 1 (TAA 5,23%) / Average Life of bonds Group 1 (CPR 5,23%):	
	-Bono 1-A2 / Bond 1-A2	3,02
	-Bono 1-B / Bond 1-B	3,02
	-Bono 1-C / Bond 1-C	3,02
	-Bono 1-D / Bond 1-D	3,69
*	Vida Media de los bonos Grupo 2 (TAA 2,72%) / Average Life of bonds Group 2 (CPR 2,72%):	
	-Bono 2-A / Bond 2-A	3,20
	-Bono 2-B / Bond 2-B	3,20
	-Bono 2-C / Bond 2-C	3,69
*	Calificación Actual de los bonos / Current rating:	
	-Bono 1-A2 / Bond 1-A2	(M) Aa1/(F) A+
	-Bono 1-B / Bond 1-B	(M) Aa1/(F) A+
	-Bono 1-C / Bond 1-C	(M) A3/(F) A+
	-Bono 1-D / Bond 1-D	(M) C/(F) CCC
	-Bono 2-A / Bond 2-A	(F) A+
	-Bono 2-B / Bond 2-B	(F) A-
	-Bono 2-C / Bond 2-C	(F) CCC

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

TDA26\Info.mensual\Ene20