

**I. DATOS IDENTIFICATIVOS**

Denominación del Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS  
Número de registro del Fondo: 9353  
NIF Fondo: V85663920  
Denominación del compartimento:  
Número de registro del compartimento:  
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.  
NIF Gestora: A80352750  
Fondo Abierto: NO  
Fondo Privado: NO  
Estados agregados: NO  
Fecha: 30/09/2017

**II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA**

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:  
(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

S.01

**Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2017**

| BALANCE (miles de euros)                                |      | Periodo actual<br>30/09/2017 |      | Periodo anterior<br>31/12/2016 |
|---|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>ACTIVO</b>   |      |                              |      |                                |
| <b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>                           | 0001 | 49.504                       | 1001 | 56.916                         |
| <b>I. Activos financieros a largo plazo</b>             | 0002 | 49.504                       | 1002 | 56.916                         |
| 1. Activos titulizados                                  | 0003 | 49.504                       | 1003 | 56.916                         |
| 1.1 Participaciones hipotecarias                        | 0004 | 0                            | 1004 | 0                              |
| 1.2 Certificados de transmisión hipotecaria             | 0005 | 0                            | 1005 | 0                              |
| 1.3 Préstamos hipotecarios                              | 0006 | 0                            | 1006 | 0                              |
| 1.4 Cédulas hipotecarias                                | 0007 | 0                            | 1007 | 0                              |
| 1.5 Préstamos a promotores                              | 0008 | 0                            | 1008 | 0                              |
| 1.6 Préstamos a PYMES                                   | 0009 | 0                            | 1009 | 0                              |
| 1.7 Préstamos a empresas                                | 0010 | 47.781                       | 1010 | 54.935                         |
| 1.8 Préstamos corporativos                              | 0011 | 0                            | 1011 | 0                              |
| 1.9 Cédulas territoriales                               | 0012 | 0                            | 1012 | 0                              |
| 1.10 Bonos de tesorería                                 | 0013 | 0                            | 1013 | 0                              |
| 1.11 Deuda subordinada                                  | 0014 | 0                            | 1014 | 0                              |
| 1.12 Créditos AAPP                                      | 0015 | 0                            | 1015 | 0                              |
| 1.13 Préstamos consumo                                  | 0016 | 0                            | 1016 | 0                              |
| 1.14 Préstamos automoción                               | 0017 | 0                            | 1017 | 0                              |
| 1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)       | 0018 | 0                            | 1018 | 0                              |
| 1.16 Cuentas a cobrar                                   | 0019 | 0                            | 1019 | 0                              |
| 1.17 Derechos de crédito futuros                        | 0020 | 0                            | 1020 | 0                              |
| 1.18 Bonos de titulización                              | 0021 | 0                            | 1021 | 0                              |
| 1.19 Cédulas internacionalización                       | 0022 | 0                            | 1022 | 0                              |
| 1.20 Otros  | 0023 | 0                            | 1023 | 0                              |
| 1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos          | 0024 | 0                            | 1024 | 0                              |
| 1.22 Activos dudosos -principal-                        | 0025 | 1.732                        | 1025 | 1.989                          |
| 1.23 Activos dudosos -intereses y otros-                | 0026 | 0                            | 1026 | 0                              |
| 1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-) | 0027 | -9                           | 1027 | -9                             |
| 1.25 Ajustes por operaciones de cobertura               | 0028 | 0                            | 1028 | 0                              |
| 2. Derivados  | 0029 | 0                            | 1029 | 0                              |
| 2.1 Derivados de cobertura                              | 0030 | 0                            | 1030 | 0                              |
| 2.2 Derivados de negociación                            | 0031 | 0                            | 1031 | 0                              |
| 3. Otros activos financieros                            | 0032 | 0                            | 1032 | 0                              |
| 3.1 Valores representativos de deuda                    | 0033 | 0                            | 1033 | 0                              |
| 3.2 Instrumentos de patrimonio                          | 0034 | 0                            | 1034 | 0                              |
| 3.3 Garantías financieras                               | 0035 | 0                            | 1035 | 0                              |
| 3.4 Otros   | 0036 | 0                            | 1036 | 0                              |
| 3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)  | 0037 | 0                            | 1037 | 0                              |
| Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía | 0038 | 0                            | 1038 | 0                              |
| <b>II. Activos por impuesto diferido</b>                | 0039 | 0                            | 1039 | 0                              |
| <b>III. Otros activos no corrientes</b>                 | 0040 | 0                            | 1040 | 0                              |

S.01

**Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2017**

| BALANCE (miles de euros)                                   |      | Periodo actual<br>30/09/2017 |      | Periodo anterior<br>31/12/2016 |
|--|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>                                 | 0041 | 44.757                       | 1041 | 45.984                         |
| <b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>  | 0042 | 0                            | 1042 | 0                              |
| <b>V. Activos financieros a corto plazo</b>                | 0043 | 7.904                        | 1043 | 8.717                          |
| 1. Activos titulizados                                     | 0044 | 7.204                        | 1044 | 7.855                          |
| 1.1 Participaciones hipotecarias                           | 0045 | 0                            | 1045 | 0                              |
| 1.2 Certificados de transmisión hipotecaria                | 0046 | 0                            | 1046 | 0                              |
| 1.3 Préstamos hipotecarios                                 | 0047 | 0                            | 1047 | 0                              |
| 1.4 Cédulas hipotecarias                                   | 0048 | 0                            | 1048 | 0                              |
| 1.5 Préstamos a promotores                                 | 0049 | 0                            | 1049 | 0                              |
| 1.6 Préstamos a PYMES                                      | 0050 | 0                            | 1050 | 0                              |
| 1.7 Préstamos a empresas                                   | 0051 | 6.824                        | 1051 | 7.403                          |
| 1.8 Préstamos corporativos                                 | 0052 | 0                            | 1052 | 0                              |
| 1.9 Cédulas territoriales                                  | 0053 | 0                            | 1053 | 0                              |
| 1.10 Bonos de tesorería                                    | 0054 | 0                            | 1054 | 0                              |
| 1.11 Deuda subordinada                                     | 0055 | 0                            | 1055 | 0                              |
| 1.12 Créditos AAPP   | 0056 | 0                            | 1056 | 0                              |
| 1.13 Préstamos consumo                                     | 0057 | 0                            | 1057 | 0                              |
| 1.14 Préstamos automoción                                  | 0058 | 0                            | 1058 | 0                              |
| 1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)          | 0059 | 0                            | 1059 | 0                              |
| 1.16 Cuentas a cobrar                                      | 0060 | 0                            | 1060 | 0                              |
| 1.17 Derechos de crédito futuros                           | 0061 | 0                            | 1061 | 0                              |
| 1.18 Bonos de titulización                                 | 0062 | 0                            | 1062 | 0                              |
| 1.19 Cédulas internacionalización                          | 0063 | 0                            | 1063 | 0                              |
| 1.20 Otros   | 0064 | 0                            | 1064 | 0                              |
| 1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos             | 0065 | 2                            | 1065 | 3                              |
| 1.22 Intereses vencidos e impagados                        | 0066 | 3                            | 1066 | 5                              |
| 1.23 Activos dudosos -principal-                           | 0067 | 378                          | 1067 | 445                            |
| 1.24 Activos dudosos -intereses-                           | 0068 | 9                            | 1068 | 10                             |
| 1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)    | 0069 | -13                          | 1069 | -13                            |
| 1.26 Ajustes por operaciones de cobertura                  | 0070 | 0                            | 1070 | 0                              |
| 2. Derivados   | 0071 | 0                            | 1071 | 0                              |
| 2.1 Derivados de cobertura                                 | 0072 | 0                            | 1072 | 0                              |
| 2.2 Derivados de negociación                               | 0073 | 0                            | 1073 | 0                              |
| 3. Otros activos financieros                               | 0074 | 701                          | 1074 | 862                            |
| 3.1 Valores representativos de deuda                       | 0075 | 0                            | 1075 | 0                              |
| 3.2 Instrumentos de patrimonio                             | 0076 | 0                            | 1076 | 0                              |
| 3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar                      | 0077 | 700                          | 1077 | 862                            |
| 3.4 Garantías financieras                                  | 0078 | 0                            | 1078 | 0                              |
| 3.5 Otros  | 0079 | 1                            | 1079 | 1                              |
| 3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)     | 0080 | 0                            | 1080 | 0                              |
| Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía    | 0081 |                              | 1081 |                                |
| <b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>                   | 0082 | 0                            | 1082 | 0                              |
| 1. Comisiones  | 0083 | 0                            | 1083 | 0                              |
| 2. Otros   | 0084 | 0                            | 1084 | 0                              |
| <b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b> | 0085 | 36.853                       | 1085 | 37.267                         |
| 1. Tesorería   | 0086 | 36.853                       | 1086 | 37.267                         |
| 2. Otros activos líquidos equivalentes                     | 0087 | 0                            | 1087 | 0                              |
| <b>TOTAL ACTIVO</b>  | 0088 | 94.261                       | 1088 | 102.899                        |

S.01

**Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2017**

| BALANCE (miles de euros)                                  |      | Periodo actual<br>30/09/2017 |      | Periodo anterior<br>31/12/2016 |
|---|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>PASIVO</b>   |      |                              |      |                                |
| <b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>                             | 0089 | 85.483                       | 1089 | 93.675                         |
| <b>I. Provisiones a largo plazo</b>                       | 0090 | 0                            | 1090 | 0                              |
| 1. Provisión garantías financieras                        | 0091 | 0                            | 1091 | 0                              |
| 2. Provisión por margen de intermediación                 | 0092 | 0                            | 1092 | 0                              |
| 3. Otras provisiones                                      | 0093 | 0                            | 1093 | 0                              |
| <b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>              | 0094 | 85.483                       | 1094 | 93.675                         |
| 1. Obligaciones y otros valores emitidos                  | 0095 | 48.066                       | 1095 | 55.882                         |
| 1.1 Series no subordinadas                                | 0096 | 0                            | 1096 | 0                              |
| 1.2 Series subordinadas                                   | 0097 | 48.066                       | 1097 | 55.882                         |
| 1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0098 | 0                            | 1098 | 0                              |
| 1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos             | 0099 | 0                            | 1099 | 0                              |
| 1.5 Ajustes por operaciones de cobertura                  | 0100 | 0                            | 1100 | 0                              |
| 2. Deudas con entidades de crédito                        | 0101 | 37.011                       | 1101 | 37.388                         |
| 2.1 Préstamo subordinado                                  | 0102 | 42.358                       | 1102 | 42.358                         |
| 2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta                   | 0103 | 0                            | 1103 | 0                              |
| 2.3 Otras deudas con entidades de crédito                 | 0104 | 0                            | 1104 | 0                              |
| 2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0105 | -5.347                       | 1105 | -4.970                         |
| 2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos             | 0106 | 0                            | 1106 | 0                              |
| 2.6 Ajustes por operaciones de cobertura                  | 0107 | 0                            | 1107 | 0                              |
| 3. Derivados  | 0108 | 405                          | 1108 | 405                            |
| 3.1 Derivados de cobertura                                | 0109 | 405                          | 1109 | 405                            |
| 3.2 Derivados de negociación                              | 0110 | 0                            | 1110 | 0                              |
| 3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0111 | 0                            | 1111 | 0                              |
| 4. Otros pasivos financieros                              | 0112 | 0                            | 1112 | 0                              |
| 4.1 Garantías financieras                                 | 0113 | 0                            | 1113 | 0                              |
| 4.1 Otros   | 0114 | 0                            | 1114 | 0                              |
| 4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0115 | 0                            | 1115 | 0                              |
| <b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>                 | 0116 | 0                            | 1116 | 0                              |

S.01

**Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2017**

| BALANCE (miles de euros)   |      | Periodo actual<br>30/09/2017 |      | Periodo anterior<br>31/12/2016 |
|--|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>B) PASIVO CORRIENTE</b>   | 0117 | 9.450                        | 1117 | 9.894                          |
| <b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b> | 0118 | 0                            | 1118 | 0                              |
| <b>V. Provisiones a corto plazo</b>  | 0119 | 0                            | 1119 | 0                              |
| 1. Provisión garantías financieras   | 0120 | 0                            | 1120 | 0                              |
| 2. Provisión por margen de intermediación  | 0121 | 0                            | 1121 | 0                              |
| 3. Otras provisiones   | 0122 | 0                            | 1122 | 0                              |
| <b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>                                     | 0123 | 9.449                        | 1123 | 9.888                          |
| 1. Obligaciones y otros valores emitidos   | 0124 | 7.205                        | 1124 | 7.853                          |
| 1.1 Series no subordinadas   | 0125 | 0                            | 1125 | 0                              |
| 1.2 Series subordinadas  | 0126 | 7.202                        | 1126 | 7.849                          |
| 1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0127 | 0                            | 1127 | 0                              |
| 1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos                                    | 0128 | 3                            | 1128 | 4                              |
| 1.5 Intereses vencidos e impagados   | 0129 | 0                            | 1129 | 0                              |
| 1.6 Ajustes por operaciones de cobertura   | 0130 | 0                            | 1130 | 0                              |
| 2. Deudas con entidades de crédito   | 0131 | 1.983                        | 1131 | 1.774                          |
| 2.1 Préstamo subordinado   | 0132 | 0                            | 1132 | 0                              |
| 2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta  | 0133 | 0                            | 1133 | 0                              |
| 2.3 Otras deudas con entidades de crédito  | 0134 | 0                            | 1134 | 0                              |
| 2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0135 | 0                            | 1135 | 0                              |
| 2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos                                    | 0136 | 2                            | 1136 | 2                              |
| 2.6 Intereses vencidos e impagados   | 0137 | 1.982                        | 1137 | 1.771                          |
| 2.7 Ajustes por operaciones de cobertura   | 0138 | 0                            | 1138 | 0                              |
| 3. Derivados   | 0139 | 261                          | 1139 | 261                            |
| 3.1 Derivados de cobertura   | 0140 | 261                          | 1140 | 261                            |
| 3.2 Derivados de negociación   | 0141 | 0                            | 1141 | 0                              |
| 3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0142 | 0                            | 1142 | 0                              |
| 4. Otros pasivos financieros   | 0143 | 0                            | 1143 | 0                              |
| 4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar   | 0144 | 0                            | 1144 | 0                              |
| 4.2 Garantías financieras  | 0145 | 0                            | 1145 | 0                              |
| 4.3 Otros  | 0146 | 0                            | 1146 | 0                              |
| 4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0147 | 0                            | 1147 | 0                              |
| <b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>  | 0148 | 0                            | 1148 | 6                              |
| 1. Comisiones  | 0149 | 0                            | 1149 | 0                              |
| 1.1 Comisión sociedad gestora  | 0150 | 0                            | 1150 | 0                              |
| 1.2 Comisión administrador   | 0151 | 0                            | 1151 | 0                              |
| 1.3 Comisión agente financiero/pagos   | 0152 | 0                            | 1152 | 0                              |
| 1.4 Comisión variable  | 0153 | 0                            | 1153 | 0                              |
| 1.5 Otras comisiones del cedente   | 0154 | 0                            | 1154 | 0                              |
| 1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0155 | 0                            | 1155 | 0                              |
| 1.7 Otras comisiones   | 0156 | 0                            | 1156 | 0                              |
| 2. Otros   | 0157 | 0                            | 1157 | 5                              |
| <b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>       | 0158 | -671                         | 1158 | -670                           |
| <b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>                       | 0159 | 0                            | 1159 | 0                              |
| <b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>                                      | 0160 | -671                         | 1160 | -670                           |
| <b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>                 | 0161 | 0                            | 1161 | 0                              |
| <b>TOTAL PASIVO</b>  | 0162 | 94.261                       | 1162 | 102.899                        |

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

| CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)                              |      | P. corriente actual (3. trimestre) |      | P. corriente anterior (3. trimestre) |      | Acumulado actual 30/09/2017 |      | Acumulado anterior 30/09/2016 |
|--|------|------------------------------------|------|--------------------------------------|------|-----------------------------|------|-------------------------------|
| <b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>                                | 0201 | 136                                | 1201 | 190                                  | 2201 | 446                         | 3201 | 618                           |
| 1.1 Activos titulizados  | 0202 | 136                                | 1202 | 190                                  | 2202 | 446                         | 3202 | 618                           |
| 1.2 Otros activos financieros  | 0203 | 0                                  | 1203 | 0                                    | 2203 | 0                           | 3203 | 0                             |
| <b>2. Intereses y cargas asimilados</b>                                      | 0204 | -196                               | 1204 | -214                                 | 2204 | -588                        | 3204 | -698                          |
| 2.1 Obligaciones y otros valores emitidos                                    | 0205 | -124                               | 1205 | -137                                 | 2205 | -373                        | 3205 | -451                          |
| 2.2 Deudas con entidades de crédito  | 0206 | -70                                | 1206 | -75                                  | 2206 | -209                        | 3206 | -245                          |
| 2.3 Otros pasivos financieros  | 0207 | -2                                 | 1207 | -1                                   | 2207 | -6                          | 3207 | -2                            |
| <b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b> | 0208 | -55                                | 1208 | -80                                  | 2208 | -182                        | 3208 | -249                          |
| <b>A) MARGEN DE INTERESES</b>  | 0209 | -115                               | 1209 | -105                                 | 2209 | -324                        | 3209 | -329                          |
| <b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>                        | 0210 | 0                                  | 1210 | 0                                    | 2210 | 0                           | 3210 | 0                             |
| 4.1 Resultados de derivados de negociación                                   | 0211 | 0                                  | 1211 | 0                                    | 2211 | 0                           | 3211 | 0                             |
| 4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG          | 0212 | 0                                  | 1212 | 0                                    | 2212 | 0                           | 3212 | 0                             |
| 4.3 Activos financieros disponibles para la venta                            | 0213 | 0                                  | 1213 | 0                                    | 2213 | 0                           | 3213 | 0                             |
| 4.4 Otros  | 0214 | 0                                  | 1214 | 0                                    | 2214 | 0                           | 3214 | 0                             |
| <b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>                                       | 0215 | 0                                  | 1215 | 0                                    | 2215 | 0                           | 3215 | 0                             |
| <b>6. Otros ingresos de explotación</b>                                      | 0216 | 0                                  | 1216 | 0                                    | 2216 | 0                           | 3216 | 0                             |
| <b>7. Otros gastos de explotación</b>  | 0217 | -14                                | 1217 | -24                                  | 2217 | -53                         | 3217 | -54                           |
| 7.1 Servicios exteriores   | 0218 | -1                                 | 1218 | -10                                  | 2218 | -12                         | 3218 | -13                           |
| 7.1.1 Servicios de profesionales independientes                              | 0219 | -1                                 | 1219 | -10                                  | 2219 | -12                         | 3219 | -13                           |
| 7.1.2 Servicios bancarios y similares  | 0220 | 0                                  | 1220 | 0                                    | 2220 | 0                           | 3220 | 0                             |
| 7.1.3 Publicidad y propaganda  | 0221 | 0                                  | 1221 | 0                                    | 2221 | 0                           | 3221 | 0                             |
| 7.1.4 Otros servicios  | 0222 | 0                                  | 1222 | 0                                    | 2222 | 0                           | 3222 | 0                             |
| 7.2 Tributos   | 0223 | 0                                  | 1223 | 0                                    | 2223 | 0                           | 3223 | 0                             |
| 7.3 Otros gastos de gestión corriente  | 0224 | -13                                | 1224 | -13                                  | 2224 | -41                         | 3224 | -41                           |
| 7.3.1 Comisión sociedad gestora  | 0225 | -10                                | 1225 | -10                                  | 2225 | -30                         | 3225 | -29                           |
| 7.3.2 Comisión administrador   | 0226 | 0                                  | 1226 | 0                                    | 2226 | 0                           | 3226 | 0                             |
| 7.3.3 Comisión agente financiero/pagos                                       | 0227 | -4                                 | 1227 | -4                                   | 2227 | -11                         | 3227 | -11                           |
| 7.3.4 Comisión variable  | 0228 | 0                                  | 1228 | 0                                    | 2228 | 0                           | 3228 | 0                             |
| 7.3.5 Otras comisiones del cedente   | 0229 | 0                                  | 1229 | 0                                    | 2229 | 0                           | 3229 | 0                             |
| 7.3.6 Otros gastos   | 0230 | 0                                  | 1230 | 0                                    | 2230 | 0                           | 3230 | 0                             |
| <b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>                            | 0231 | 0                                  | 1231 | 0                                    | 2231 | 0                           | 3231 | 50                            |
| 8.1 Deterioro neto de activos titulizados                                    | 0232 | 0                                  | 1232 | 0                                    | 2232 | 0                           | 3232 | 50                            |
| 8.2 Deterioro neto de otros activos financieros                              | 0233 | 0                                  | 1233 | 0                                    | 2233 | 0                           | 3233 | 0                             |
| <b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>                                    | 0234 | 0                                  | 1234 | 0                                    | 2234 | 0                           | 3234 | 0                             |
| 9.1 Dotación provisión por garantías financieras                             | 0235 | 0                                  | 1235 | 0                                    | 2235 | 0                           | 3235 | 0                             |
| 9.2 Dotación provisión por margen de intermediación                          | 0236 | 0                                  | 1236 | 0                                    | 2236 | 0                           | 3236 | 0                             |
| 9.3 Dotación otras provisiones   | 0237 | 0                                  | 1237 | 0                                    | 2237 | 0                           | 3237 | 0                             |
| <b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>            | 0238 | 0                                  | 1238 | 0                                    | 2238 | 0                           | 3238 | 0                             |
| <b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>                               | 0239 | 129                                | 1239 | 128                                  | 2239 | 376                         | 3239 | 334                           |
| <b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>                                       | 0240 | 0                                  | 1240 | 0                                    | 2240 | 0                           | 3240 | 0                             |
| <b>12. Impuesto sobre beneficios</b>   | 0241 | 0                                  | 1241 | 0                                    | 2241 | 0                           | 3241 | 0                             |
| <b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>  | 0242 | 0                                  | 1242 | 0                                    | 2242 | 0                           | 3242 | 0                             |

S.03

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

| ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)                                    |      | P. corriente actual (3. trimestre) |      | P. corriente anterior (3. trimestre) |      | Acumulado actual 30/09/2017 |      | Acumulado anterior 30/09/2016 |
|--|------|------------------------------------|------|--------------------------------------|------|-----------------------------|------|-------------------------------|
| <b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>                          | 0300 | -57                                | 1300 | -40                                  | 2300 | -153                        | 3300 | -118                          |
| <b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>                    | 0301 | -44                                | 1301 | -26                                  | 2301 | -112                        | 3301 | -78                           |
| 1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados                                | 0302 | 137                                | 1302 | 194                                  | 2302 | 451                         | 3302 | 628                           |
| 1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos              | 0303 | -124                               | 1303 | -137                                 | 2303 | -374                        | 3303 | -454                          |
| 1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura                             | 0304 | 0                                  | 1304 | 0                                    | 2304 | 0                           | 3304 | 0                             |
| 1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura                              | 0305 | -55                                | 1305 | -81                                  | 2305 | -183                        | 3305 | -250                          |
| 1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros                              | 0306 | 0                                  | 1306 | 0                                    | 2306 | 0                           | 3306 | 0                             |
| 1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito                        | 0307 | 0                                  | 1307 | 0                                    | 2307 | 0                           | 3307 | 0                             |
| 1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)                                      | 0308 | -2                                 | 1308 | -2                                   | 2308 | -6                          | 3308 | -2                            |
| <b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>                  | 0309 | -13                                | 1309 | -13                                  | 2309 | -40                         | 3309 | -40                           |
| 2.1 Comisión sociedad gestora  | 0310 | -10                                | 1310 | -10                                  | 2310 | -30                         | 3310 | -29                           |
| 2.2 Comisión administrador   | 0311 | 0                                  | 1311 | 0                                    | 2311 | 0                           | 3311 | 0                             |
| 2.3 Comisión agente financiero/pagos   | 0312 | -4                                 | 1312 | -4                                   | 2312 | -11                         | 3312 | -11                           |
| 2.4 Comisión variable  | 0313 | 0                                  | 1313 | 0                                    | 2313 | 0                           | 3313 | 0                             |
| 2.5 Otras comisiones   | 0314 | 0                                  | 1314 | 0                                    | 2314 | 0                           | 3314 | 0                             |
| <b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>        | 0315 | 0                                  | 1315 | 0                                    | 2315 | 0                           | 3315 | 0                             |
| 3.1 Pagos por garantías financieras  | 0316 | 0                                  | 1316 | 0                                    | 2316 | 0                           | 3316 | 0                             |
| 3.2 Cobros por garantías financieras   | 0317 | 0                                  | 1317 | 0                                    | 2317 | 0                           | 3317 | 0                             |
| 3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación                            | 0318 | 0                                  | 1318 | 0                                    | 2318 | 0                           | 3318 | 0                             |
| 3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación                           | 0319 | 0                                  | 1319 | 0                                    | 2319 | 0                           | 3319 | 0                             |
| 3.5 Otros pagos de explotación   | 0320 | 0                                  | 1320 | 0                                    | 2320 | 0                           | 3320 | 0                             |
| 3.6 Otros cobros de explotación  | 0321 | 0                                  | 1321 | 0                                    | 2321 | 0                           | 3321 | 0                             |
| <b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>                 | 0322 | -414                               | 1322 | -188                                 | 2322 | -261                        | 3322 | -804                          |
| <b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>            | 0323 | 0                                  | 1323 | 0                                    | 2323 | 0                           | 3323 | 0                             |
| <b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>                  | 0324 | 0                                  | 1324 | 0                                    | 2324 | 0                           | 3324 | 0                             |
| <b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b> | 0325 | -413                               | 1325 | -178                                 | 2325 | -243                        | 3325 | -788                          |
| 6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados                     | 0326 | 1.607                              | 1326 | 1.699                                | 2326 | 5.073                       | 3326 | 5.841                         |
| 6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados                    | 0327 | 422                                | 1327 | 700                                  | 2327 | 2.485                       | 3327 | 3.449                         |
| 6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados          | 0328 | 118                                | 1328 | 220                                  | 2328 | 663                         | 3328 | 755                           |
| 6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos    | 0329 | 0                                  | 1329 | 0                                    | 2329 | 0                           | 3329 | 0                             |
| 6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías     | 0330 | 0                                  | 1330 | 0                                    | 2330 | 0                           | 3330 | 0                             |
| 6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos              | 0331 | -2.560                             | 1331 | -2.797                               | 2331 | -8.463                      | 3331 | -10.833                       |
| <b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>                     | 0332 | -1                                 | 1332 | -10                                  | 2332 | -18                         | 3332 | -16                           |
| 7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito                      | 0333 | 0                                  | 1333 | 0                                    | 2333 | 0                           | 3333 | 0                             |
| 7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito                       | 0334 | 0                                  | 1334 | 0                                    | 2334 | 0                           | 3334 | 0                             |
| 7.3 Pagos a Administraciones públicas  | 0335 | 0                                  | 1335 | 0                                    | 2335 | 0                           | 3335 | 0                             |
| 7.4 Otros cobros y pagos   | 0336 | -1                                 | 1336 | -10                                  | 2336 | -18                         | 3336 | -16                           |
| <b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>              | 0337 | -471                               | 1337 | -228                                 | 2337 | -413                        | 3337 | -922                          |
| Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo                                  | 0338 | 37.324                             | 1338 | 37.236                               | 2338 | 37.267                      | 3338 | 37.930                        |
| Efectivo o equivalentes al final del periodo                                     | 0339 | 36.853                             | 1339 | 37.008                               | 2339 | 36.853                      | 3339 | 37.008                        |

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

| INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)   |             | P. corriente actual (3. trimestre) |             | P. corriente anterior (3. trimestre) |             | Acumulado actual 30/09/2017 |             | Acumulado anterior 30/09/2016 |
|--|-------------|------------------------------------|-------------|--------------------------------------|-------------|-----------------------------|-------------|-------------------------------|
| <b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>  |             |                                    |             |                                      |             |                             |             |                               |
| 1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración  | 0350        | 0                                  | 1350        | 0                                    | 2350        | 0                           | 3350        | 0                             |
| 1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración   | 0351        | 0                                  | 1351        | 0                                    | 2351        | 0                           | 3351        | 0                             |
| 1.1.2 Efecto fiscal  | 0352        | 0                                  | 1352        | 0                                    | 2352        | 0                           | 3352        | 0                             |
| 1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias  | 0353        | 0                                  | 1353        | 0                                    | 2353        | 0                           | 3353        | 0                             |
| 1.3 Otras reclasificaciones  | 0354        | 0                                  | 1354        | 0                                    | 2354        | 0                           | 3354        | 0                             |
| 1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período  | 0355        | 0                                  | 1355        | 0                                    | 2355        | 0                           | 3355        | 0                             |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>                   | <b>0356</b> | <b>0</b>                           | <b>1356</b> | <b>0</b>                             | <b>2356</b> | <b>0</b>                    | <b>3356</b> | <b>0</b>                      |
| <b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>  |             |                                    |             |                                      |             |                             |             |                               |
| 2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración  | 0357        | -55                                | 1357        | -81                                  | 2357        | -183                        | 3357        | -250                          |
| 2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración   | 0358        | -55                                | 1358        | -81                                  | 2358        | -183                        | 3358        | -250                          |
| 2.1.2 Efecto fiscal  | 0359        | 0                                  | 1359        | 0                                    | 2359        | 0                           | 3359        | 0                             |
| 2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias  | 0360        | 55                                 | 1360        | 80                                   | 2360        | 182                         | 3360        | 249                           |
| 2.3 Otras reclasificaciones  | 0361        | 0                                  | 1361        | 0                                    | 2361        | 0                           | 3361        | 0                             |
| 2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período  | 0362        | 0                                  | 1362        | 0                                    | 2362        | 1                           | 3362        | 1                             |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>  | <b>0363</b> | <b>0</b>                           | <b>1363</b> | <b>0</b>                             | <b>2363</b> | <b>0</b>                    | <b>3363</b> | <b>0</b>                      |
| <b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>   |             |                                    |             |                                      |             |                             |             |                               |
| 3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período | 0364        | 0                                  | 1364        | 0                                    | 2364        | 0                           | 3364        | 0                             |
| 3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración   | 0365        | 0                                  | 1365        | 0                                    | 2365        | 0                           | 3365        | 0                             |
| 3.1.2 Efecto fiscal  | 0366        | 0                                  | 1366        | 0                                    | 2366        | 0                           | 3366        | 0                             |
| 3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias  | 0367        | 0                                  | 1367        | 0                                    | 2367        | 0                           | 3367        | 0                             |
| 3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período  | 0368        | 0                                  | 1368        | 0                                    | 2368        | 0                           | 3368        | 0                             |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>  | <b>0369</b> | <b>0</b>                           | <b>1369</b> | <b>0</b>                             | <b>2369</b> | <b>0</b>                    | <b>3369</b> | <b>0</b>                      |
| <b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>  | <b>0370</b> | <b>0</b>                           | <b>1370</b> | <b>0</b>                             | <b>2370</b> | <b>0</b>                    | <b>3370</b> | <b>0</b>                      |



Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: BMN

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

| Ratios (%)                                   | Situación actual 30/09/2017 |      |                 |      |                               |      |                                 |      | Situación cierre anual anterior 31/12/2016 |      |                 |      |                               |      |                                 |      | Hipótesis iniciales folleto/escritura |      |                 |      |                               |      |                                 |      |
|--|-----------------------------|------|-----------------|------|-------------------------------|------|---------------------------------|------|--|------|-----------------|------|-------------------------------|------|---------------------------------|------|---------------------------------------|------|-----------------|------|-------------------------------|------|---------------------------------|------|
|  | Tasa de activos dudosos     |      | Tasa de fallido |      | Tasa de recuperación fallidos |      | Tasa de amortización anticipada |      | Tasa de activos dudosos                    |      | Tasa de fallido |      | Tasa de recuperación fallidos |      | Tasa de amortización anticipada |      | Tasa de activos dudosos               |      | Tasa de fallido |      | Tasa de recuperación fallidos |      | Tasa de amortización anticipada |      |
| Participaciones hipotecarias                 | 0380                        |      | 0400            |      | 0420                          |      | 0440                            |      | 1380                                       |      | 1400            |      | 1420                          |      | 1440                            |      | 2380                                  |      | 2400            |      | 2420                          |      | 2440                            |      |
| Certificados de transmisión de hipoteca      | 0381                        |      | 0401            |      | 0421                          |      | 0441                            |      | 1381                                       |      | 1401            |      | 1421                          |      | 1441                            |      | 2381                                  |      | 2401            |      | 2421                          |      | 2441                            |      |
| Préstamos hipotecarios                       | 0382                        |      | 0402            |      | 0422                          |      | 0442                            |      | 1382                                       |      | 1402            |      | 1422                          |      | 1442                            |      | 2382                                  |      | 2402            |      | 2422                          |      | 2442                            |      |
| Cédulas hipotecarias                         | 0383                        |      | 0403            |      | 0423                          |      | 0443                            |      | 1383                                       |      | 1403            |      | 1423                          |      | 1443                            |      | 2383                                  |      | 2403            |      | 2423                          |      | 2443                            |      |
| Préstamos a promotores                       | 0384                        |      | 0404            |      | 0424                          |      | 0444                            |      | 1384                                       |      | 1404            |      | 1424                          |      | 1444                            |      | 2384                                  |      | 2404            |      | 2424                          |      | 2444                            |      |
| Préstamos a PYMES                            | 0385                        |      | 0405            |      | 0425                          |      | 0445                            |      | 1385                                       |      | 1405            |      | 1425                          |      | 1445                            |      | 2385                                  |      | 2405            |      | 2425                          |      | 2445                            |      |
| Préstamos a empresas                         | 0386                        | 3,72 | 0406            | 0,00 | 0426                          | 0,00 | 0446                            | 5,68 | 1386                                       | 3,76 | 1406            | 0,00 | 1426                          | 0,00 | 1446                            | 6,32 | 2386                                  | 0,00 | 2406            | 0,00 | 2426                          | 0,00 | 2446                            | 8,00 |
| Préstamos corporativos                       | 0387                        |      | 0407            |      | 0427                          |      | 0447                            |      | 1387                                       |      | 1407            |      | 1427                          |      | 1447                            |      | 2387                                  |      | 2407            |      | 2427                          |      | 2447                            |      |
| Cédulas territoriales                        | 0388                        |      | 0408            |      | 0428                          |      | 0448                            |      | 1388                                       |      | 1408            |      | 1428                          |      | 1448                            |      | 2388                                  |      | 2408            |      | 2428                          |      | 2448                            |      |
| Bonos de tesorería                           | 0389                        |      | 0409            |      | 0429                          |      | 0449                            |      | 1389                                       |      | 1409            |      | 1429                          |      | 1449                            |      | 2389                                  |      | 2409            |      | 2429                          |      | 2449                            |      |
| Deuda subordinada                            | 0390                        |      | 0410            |      | 0430                          |      | 0450                            |      | 1390                                       |      | 1410            |      | 1430                          |      | 1450                            |      | 2390                                  |      | 2410            |      | 2430                          |      | 2450                            |      |
| Créditos AAPP                                | 0391                        |      | 0411            |      | 0431                          |      | 0451                            |      | 1391                                       |      | 1411            |      | 1431                          |      | 1451                            |      | 2391                                  |      | 2411            |      | 2431                          |      | 2451                            |      |
| Préstamos consumo                            | 0392                        |      | 0412            |      | 0432                          |      | 0452                            |      | 1392                                       |      | 1412            |      | 1432                          |      | 1452                            |      | 2392                                  |      | 2412            |      | 2432                          |      | 2452                            |      |
| Préstamos automoción                         | 0393                        |      | 0413            |      | 0433                          |      | 0453                            |      | 1393                                       |      | 1413            |      | 1433                          |      | 1453                            |      | 2393                                  |      | 2413            |      | 2433                          |      | 2453                            |      |
| Cuotas de arrendamiento financiero (leasing) | 0394                        |      | 0414            |      | 0434                          |      | 0454                            |      | 1394                                       |      | 1414            |      | 1434                          |      | 1454                            |      | 2394                                  |      | 2414            |      | 2434                          |      | 2454                            |      |
| Cuentas a cobrar                             | 0395                        |      | 0415            |      | 0435                          |      | 0455                            |      | 1395                                       |      | 1415            |      | 1435                          |      | 1455                            |      | 2395                                  |      | 2415            |      | 2435                          |      | 2455                            |      |
| Derechos de crédito futuros                  | 0396                        |      | 0416            |      | 0436                          |      | 0456                            |      | 1396                                       |      | 1416            |      | 1436                          |      | 1456                            |      | 2396                                  |      | 2416            |      | 2436                          |      | 2456                            |      |
| Bonos de titulización                        | 0397                        |      | 0417            |      | 0437                          |      | 0457                            |      | 1397                                       |      | 1417            |      | 1437                          |      | 1457                            |      | 2397                                  |      | 2417            |      | 2437                          |      | 2457                            |      |
| Cédulas internacionalización                 | 0398                        |      | 0418            |      | 0438                          |      | 0458                            |      | 1398                                       |      | 1418            |      | 1438                          |      | 1458                            |      | 2398                                  |      | 2418            |      | 2438                          |      | 2458                            |      |
| Otros  | 0399                        |      | 0419            |      | 0439                          |      | 0459                            |      | 1399                                       |      | 1419            |      | 1439                          |      | 1459                            |      | 2399                                  |      | 2419            |      | 2439                          |      | 2459                            |      |

S.05.1

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: BMN

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

| Total Impagados (miles de euros) | Nº de activos |           | Importe impagado            |            |                                      |           |   |           |             |            | Principal pendiente no vencido |              | Otros importes |          | Deuda Total |              |
|----------------------------------|---------------|-----------|-----------------------------|------------|--------------------------------------|-----------|---|-----------|-------------|------------|--------------------------------|--------------|----------------|----------|-------------|--------------|
|                                  |               |           | Principal pendiente vencido |            | Intereses devengados en contabilidad |           | Intereses interrumpidos en contabilidad |           | Total       |            |                                |              |                |          |             |              |
| Hasta 1 mes                      | 0460          | 40        | 0467                        | 28         | 0474                                 | 2         | 0481                                    | 0         | 0488        | 30         | 0495                           | 3.533        | 0502           | 0        | 0509        | 3.562        |
| De 1 a 3 meses                   | 0461          | 12        | 0468                        | 33         | 0475                                 | 1         | 0482                                    | 0         | 0489        | 34         | 0496                           | 950          | 0503           | 0        | 0510        | 985          |
| De 3 a 6 meses                   | 0462          | 0         | 0469                        | 0          | 0476                                 | 0         | 0483                                    | 0         | 0490        | 0          | 0497                           | 0            | 0504           | 0        | 0511        | 0            |
| De 6 a 9 meses                   | 0463          | 1         | 0470                        | 1          | 0477                                 | 0         | 0484                                    | 0         | 0491        | 1          | 0498                           | 44           | 0505           | 0        | 0512        | 45           |
| De 9 a 12 meses                  | 0464          | 0         | 0471                        | 0          | 0478                                 | 0         | 0485                                    | 0         | 0492        | 0          | 0499                           | 0            | 0506           | 0        | 0513        | 0            |
| Más de 12 meses                  | 0465          | 23        | 0472                        | 205        | 0479                                 | 9         | 0486                                    | 43        | 0493        | 257        | 0500                           | 1.861        | 0507           | 0        | 0514        | 2.118        |
| <b>Total</b>                     | <b>0466</b>   | <b>76</b> | <b>0473</b>                 | <b>267</b> | <b>0480</b>                          | <b>13</b> | <b>0487</b>                             | <b>43</b> | <b>0494</b> | <b>322</b> | <b>0501</b>                    | <b>6.387</b> | <b>0508</b>    | <b>0</b> | <b>1515</b> | <b>6.709</b> |

| Impagados con garantía real (miles de euros) | Nº de activos |           | Importe impagado            |            |                                      |           |   |           |             |            | Principal pendiente no vencido |              | Otros importes |          | Deuda Total |              | Valor garantía |               | Valor Garantía con Tasación > 2 años |        | % Deuda / v. Tasación |              |
|--|---------------|-----------|-----------------------------|------------|--------------------------------------|-----------|---|-----------|-------------|------------|--------------------------------|--------------|----------------|----------|-------------|--------------|----------------|---------------|--------------------------------------|--------|-----------------------|--------------|
|  |               |           | Principal pendiente vencido |            | Intereses devengados en contabilidad |           | Intereses interrumpidos en contabilidad |           | Total       |            |                                |              |                |          |             |              |                |               |                                      |        |                       |              |
| Hasta 1 mes                                  | 0515          | 38        | 0522                        | 16         | 0529                                 | 1         | 0536                                    | 0         | 0543        | 17         | 0550                           | 2.626        | 0557           | 0        | 0564        | 2.643        | 0571           | 11.593        | 0578                                 | 11.593 | 0584                  | 22,80        |
| De 1 a 3 meses                               | 0516          | 11        | 0523                        | 25         | 0530                                 | 1         | 0537                                    | 0         | 0544        | 26         | 0551                           | 907          | 0558           | 0        | 0565        | 934          | 0572           | 3.652         | 0579                                 | 3.652  | 0585                  | 25,56        |
| De 3 a 6 meses                               | 0517          | 0         | 0524                        | 0          | 0531                                 | 0         | 0538                                    | 0         | 0545        | 0          | 0552                           | 0            | 0559           | 0        | 0566        | 0            | 0573           | 0             | 0580                                 | 0      | 0586                  | 0,00         |
| De 6 a 9 meses                               | 0518          | 1         | 0525                        | 1          | 0532                                 | 0         | 0539                                    | 0         | 0546        | 1          | 0553                           | 44           | 0560           | 0        | 0567        | 45           | 0574           | 500           | 0581                                 | 500    | 0587                  | 8,97         |
| De 9 a 12 meses                              | 0519          | 0         | 0526                        | 0          | 0533                                 | 0         | 0540                                    | 0         | 0547        | 0          | 0554                           | 0            | 0561           | 0        | 0568        | 0            | 0575           | 0             | 0582                                 | 0      | 0588                  | 0,00         |
| Más de 12 meses                              | 0520          | 23        | 0527                        | 205        | 0534                                 | 9         | 0541                                    | 43        | 0548        | 257        | 0555                           | 1.861        | 0562           | 0        | 0569        | 2.118        | 0576           | 8.727         | 0583                                 | 8.727  | 0589                  | 24,27        |
| <b>Total</b>                                 | <b>0521</b>   | <b>73</b> | <b>0528</b>                 | <b>247</b> | <b>0535</b>                          | <b>12</b> | <b>0542</b>                             | <b>43</b> | <b>0549</b> | <b>301</b> | <b>0556</b>                    | <b>5.437</b> | <b>0563</b>    | <b>0</b> | <b>0570</b> | <b>5.739</b> | <b>0577</b>    | <b>24.471</b> |                                      |        | <b>0590</b>           | <b>23,45</b> |

S.05.1

**Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2017**

**Entidades cedentes de los activos titulizados: BMN**

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO C**

| Vida residual de los activos titulizados (miles de euros) | Principal pendiente         |               |  |               |                              |                |
|---|-----------------------------|---------------|--|---------------|------------------------------|----------------|
|   | Situación actual 30/09/2017 |               | Situación cierre anual anterior 31/12/2016 |               | Situación inicial 26/03/2009 |                |
| Inferior a 1 año  | 0600                        | 223           | 1600                                       | 333           | 2600                         | 0              |
| Entre 1 y 2 años  | 0601                        | 561           | 1601                                       | 448           | 2601                         | 1.563          |
| Entre 2 y 3 años  | 0602                        | 2.582         | 1602                                       | 1.239         | 2602                         | 11.824         |
| Entre 3 y 4 años  | 0603                        | 1.995         | 1603                                       | 3.353         | 2603                         | 19.948         |
| Entre 4 y 5 años  | 0604                        | 4.900         | 1604                                       | 2.955         | 2604                         | 9.276          |
| Entre 5 y 10 años   | 0605                        | 14.439        | 1605                                       | 20.097        | 2605                         | 54.488         |
| Superior a 10 años  | 0606                        | 32.015        | 1606                                       | 36.348        | 2606                         | 257.901        |
| <b>Total</b>  | 0607                        | <b>56.715</b> | 1607                                       | <b>64.773</b> | 2607                         | <b>355.000</b> |
| <b>Vida residual media ponderada (años)</b>               | 0608                        | <b>12,13</b>  | 1608                                       | <b>12,39</b>  | 2608                         | <b>14,56</b>   |

| Antigüedad                        | Situación actual 30/09/2017 |       | Situación cierre anual anterior 31/12/2016 |       | Situación inicial 26/03/2009 |      |
|-----------------------------------|-----------------------------|-------|--|-------|------------------------------|------|
| Antigüedad media ponderada (años) | 0609                        | 11,26 | 1609                                       | 10,51 | 2609                         | 2,67 |

|  |
|--|
| <b>S.05.1</b>  |
| <b>Denominación Fondo:</b> TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA               |
| <b>Denominación del compartimento:</b>                                 |
| <b>Denominación de la gestora:</b> Titulización de Activos, SGFT, S.A. |
| <b>Estados agregados:</b> NO   |
| <b>Fecha:</b> 30/09/2017   |
| <b>Entidades cedentes de los activos titulizados:</b> BMN              |

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO D**

| Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros) | Situación actual 30/09/2017 |              |                     |               | Situación cierre anual anterior 31/12/2016 |              |                     |               | Situación inicial 26/03/2009 |              |                     |                |
|---|-----------------------------|--------------|---------------------|---------------|--|--------------|---------------------|---------------|------------------------------|--------------|---------------------|----------------|
|   | Nº de activos vivos         |              | Principal pendiente |               | Nº de activos vivos                        |              | Principal pendiente |               | Nº de activos vivos          |              | Principal pendiente |                |
| 0% - 40%  | 0620                        | 458          | 0630                | 31.082        | 1620                                       | 464          | 1630                | 33.465        | 2620                         | 611          | 2630                | 110.576        |
| 40% - 60%   | 0621                        | 181          | 0631                | 21.220        | 1621                                       | 219          | 1631                | 25.332        | 2621                         | 194          | 2631                | 41.911         |
| 60% - 80%   | 0622                        | 19           | 0632                | 2.357         | 1622                                       | 25           | 1632                | 3.573         | 2622                         | 649          | 2632                | 145.537        |
| 80% - 100%  | 0623                        | 0            | 0633                | 0             | 1623                                       | 0            | 1633                | 0             | 2623                         | 60           | 2633                | 8.984          |
| 100% - 120%   | 0624                        | 0            | 0634                | 0             | 1624                                       | 0            | 1634                | 0             | 2624                         | 0            | 2634                | 0              |
| 120% - 140%   | 0625                        | 0            | 0635                | 0             | 1625                                       | 0            | 1635                | 0             | 2625                         | 0            | 2635                | 0              |
| 140% - 160%   | 0626                        | 0            | 0636                | 0             | 1626                                       | 0            | 1636                | 0             | 2626                         | 0            | 2636                | 0              |
| superior al 160%  | 0627                        | 0            | 0637                | 0             | 1627                                       | 0            | 1637                | 0             | 2627                         | 0            | 2637                | 0              |
| <b>Total</b>  | 0628                        | <b>658</b>   | 0638                | <b>54.659</b> | 1628                                       | <b>708</b>   | 1638                | <b>62.370</b> | 2628                         | <b>1.514</b> | 2638                | <b>307.009</b> |
| <b>Media ponderada (%)</b>  | 0639                        | <b>34,35</b> | 0649                |               | 1639                                       | <b>35,57</b> | 1649                |               | 2639                         | <b>49,30</b> | 2649                |                |

S.05.1

**Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2017**

**Entidades cedentes de los activos titulizados: BMN**

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

| Tipos de interés de los activos titulizados (%) | Situación actual<br>30/09/2017 |      | Situación cierre anual anterior<br>31/12/2016 |      | Situación inicial 26/03/2009 |      |
|---|--------------------------------|------|---|------|------------------------------|------|
|   |                                |      |   |      |                              |      |
| Tipo de interés medio ponderado                 | 0650                           | 1,00 | 1650  | 1,11 | 2650                         | 5,26 |
| Tipo de interés nominal máximo                  | 0651                           | 4,50 | 1651  | 4,50 | 2651                         | 8,13 |
| Tipo de interés nominal mínimo                  | 0652                           | 0,32 | 1652  | 0,33 | 2652                         | 2,59 |

S.05.1

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: BMN

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO F**

| Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros) | Situación actual 30/09/2017 |            |                     |               | Situación cierre anual anterior 31/12/2016 |            |                     |               | Situación inicial 26/03/2009 |              |                     |                |
|--|-----------------------------|------------|---------------------|---------------|--|------------|---------------------|---------------|------------------------------|--------------|---------------------|----------------|
|  | Nº de activos vivos         |            | Principal pendiente |               | Nº de activos vivos                        |            | Principal pendiente |               | Nº de activos vivos          |              | Principal pendiente |                |
| Andalucía  | 0660                        | 1          | 0683                | 311           | 1660                                       | 1          | 1683                | 354           | 2660                         | 5            | 2683                | 3.539          |
| Aragón   | 0661                        | 0          | 0684                | 0             | 1661                                       | 0          | 1684                | 0             | 2661                         | 0            | 2684                | 0              |
| Asturias   | 0662                        | 0          | 0685                | 0             | 1662                                       | 0          | 1685                | 0             | 2662                         | 0            | 2685                | 0              |
| Baleares   | 0663                        | 649        | 0686                | 53.103        | 1663                                       | 701        | 1686                | 60.931        | 2663                         | 1.610        | 2686                | 334.468        |
| Canarias   | 0664                        | 2          | 0687                | 122           | 1664                                       | 2          | 1687                | 127           | 2664                         | 4            | 2687                | 1.274          |
| Cantabria  | 0665                        | 0          | 0688                | 0             | 1665                                       | 0          | 1688                | 0             | 2665                         | 0            | 2688                | 0              |
| Castilla-León  | 0666                        | 0          | 0689                | 0             | 1666                                       | 0          | 1689                | 0             | 2666                         | 2            | 2689                | 845            |
| Castilla La Mancha   | 0667                        | 1          | 0690                | 40            | 1667                                       | 1          | 1690                | 45            | 2667                         | 5            | 2690                | 987            |
| Cataluña   | 0668                        | 4          | 0691                | 347           | 1668                                       | 4          | 1691                | 374           | 2668                         | 13           | 2691                | 2.394          |
| Ceuta  | 0669                        | 0          | 0692                | 0             | 1669                                       | 0          | 1692                | 0             | 2669                         | 0            | 2692                | 0              |
| Extremadura  | 0670                        | 0          | 0693                | 0             | 1670                                       | 0          | 1693                | 0             | 2670                         | 0            | 2693                | 0              |
| Galicia  | 0671                        | 0          | 0694                | 0             | 1671                                       | 0          | 1694                | 0             | 2671                         | 0            | 2694                | 0              |
| Madrid   | 0672                        | 4          | 0695                | 1.117         | 1672                                       | 4          | 1695                | 1.206         | 2672                         | 26           | 2695                | 6.497          |
| Melilla  | 0673                        | 0          | 0696                | 0             | 1673                                       | 0          | 1696                | 0             | 2673                         | 0            | 2696                | 0              |
| Murcia   | 0674                        | 0          | 0697                | 0             | 1674                                       | 0          | 1697                | 0             | 2674                         | 1            | 2697                | 255            |
| Navarra  | 0675                        | 0          | 0698                | 0             | 1675                                       | 0          | 1698                | 0             | 2675                         | 0            | 2698                | 0              |
| La Rioja   | 0676                        | 0          | 0699                | 0             | 1676                                       | 0          | 1699                | 0             | 2676                         | 0            | 2699                | 0              |
| Comunidad Valenciana   | 0677                        | 15         | 0700                | 1.675         | 1677                                       | 15         | 1700                | 1.735         | 2677                         | 31           | 2700                | 4.741          |
| País Vasco   | 0678                        | 0          | 0701                | 0             | 1678                                       | 0          | 1701                | 0             | 2678                         | 0            | 2701                | 0              |
| <b>Total España</b>  | 0679                        | <b>676</b> | 0702                | <b>56.715</b> | 1679                                       | <b>728</b> | 1702                | <b>64.773</b> | 2679                         | <b>1.697</b> | 2702                | <b>355.000</b> |
| Otros países Unión Europea                                   | 0680                        | 0          | 0703                | 0             | 1680                                       | 0          | 1703                | 0             | 2680                         | 0            | 2703                | 0              |
| Resto  | 0681                        | 0          | 0704                | 0             | 1681                                       | 0          | 1704                | 0             | 2681                         | 0            | 2704                | 0              |
| <b>Total general</b>   | 0682                        | <b>676</b> | 0705                | <b>56.715</b> | 1682                                       | <b>728</b> | 1705                | <b>64.773</b> | 2682                         | <b>1.697</b> | 2705                | <b>355.000</b> |

S.05.1

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: BMN

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

| Concentración   | Situación actual 30/09/2017 |       |      |    | Situación cierre anual anterior 31/12/2016 |       |      |    | Situación inicial 26/03/2009 |       |      |    |
|---|-----------------------------|-------|------|----|--|-------|------|----|------------------------------|-------|------|----|
|   | Porcentaje                  |       | CNAE |    | Porcentaje                                 |       | CNAE |    | Porcentaje                   |       | CNAE |    |
| Diez primeros deudores/emisores con más concentración | 0710                        | 12,81 |      |    | 1710                                       | 12,99 |      |    | 2710                         | 13,44 |      |    |
| Sector  | 0711                        | 12,47 | 0712 | 99 | 1711                                       | 12,24 | 1712 | 99 | 2711                         | 14,50 | 2712 | 55 |

S.05.2

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO A**

| (miles de euros) |                    | Situación actual 30/09/2017 |        |                      | Situación cierre anual anterior 31/12/2016 |        |                      | Situación inicial 26/03/2009 |         |                      |       |      |         |
|------------------|--------------------|-----------------------------|--------|----------------------|--|--------|----------------------|------------------------------|---------|----------------------|-------|------|---------|
| Serie            | Denominación serie | Nº de pasivos emitidos      |        | Nominal unitario (€) | Nº de pasivos emitidos                     |        | Nominal unitario (€) | Nº de pasivos emitidos       |         | Nominal unitario (€) |       |      |         |
|                  |                    | 0720                        | 0721   | 0722                 | 1720                                       | 1721   | 1722                 | 2720                         | 2721    | 2722                 |       |      |         |
| ES0377957008     | SERIE A            | 2.577                       | 0      | 0                    | 2.577                                      | 0      | 0                    | 2.577                        | 100.000 | 257.700              |       |      |         |
| ES0377957016     | SERIE B            | 504                         | 26.930 | 13.573               | 504  | 43.722 | 22.036               | 504                          | 100.000 | 50.400               |       |      |         |
| ES0377957024     | SERIE C            | 365                         | 87.525 | 31.946               | 365  | 87.525 | 31.946               | 365                          | 100.000 | 36.500               |       |      |         |
| ES0377957032     | SERIE D            | 104                         | 93.739 | 9.749                | 104  | 93.739 | 9.749                | 104                          | 100.000 | 10.400               |       |      |         |
| <b>Total</b>     |                    | 0723                        | 3.550  | 0724                 | 55.268                                     | 1723   | 3.550                | 1724                         | 63.731  | 2723                 | 3.550 | 2724 | 355.000 |



S.05.2

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO B**

| (miles de euros) |                    |                        | Intereses            |        |               |                      |                     | Principal pendiente                   |                      |                    |        | Total Pendiente | Correcciones de valor por repercusión de pérdidas |      |        |      |   |
|------------------|--------------------|------------------------|----------------------|--------|---------------|----------------------|---------------------|---------------------------------------|----------------------|--------------------|--------|-----------------|---|------|--------|------|---|
| Serie            | Denominación serie | Grado de subordinación | Índice de referencia | Margen | Tipo aplicado | Intereses Acumulados | Intereses impagados | Serie devenga Intereses en el periodo | Principal no vencido | Principal impagado |        |                 |   |      |        |      |   |
|                  |                    | 0730                   | 0731                 | 0732   | 0733          | 0734                 | 0735                | 0742                                  | 0736                 | 0737               | 0738   | 0739            |   |      |        |      |   |
| ES0377957008     | SERIE A            | NS                     | EURIBOR 3 m          | 0,30   | 0,00          | 0                    | 0                   | NO                                    | 0                    | 0                  | 0      | 0               |   |      |        |      |   |
| ES0377957016     | SERIE B            | S                      | EURIBOR 3 m          | 0,50   | 0,17          | 0                    | 0                   | NO                                    | 13.573               | 0                  | 13.573 | 0               |   |      |        |      |   |
| ES0377957024     | SERIE C            | S                      | EURIBOR 3 m          | 1,25   | 0,92          | 2                    | 0                   | NO                                    | 31.946               | 0                  | 31.948 | 0               |   |      |        |      |   |
| ES0377957032     | SERIE D            | S                      | EURIBOR 3 m          | 2,00   | 1,67          | 1                    | 0                   | NO                                    | 9.749                | 0                  | 9.750  | 0               |   |      |        |      |   |
| <b>Total</b>     |                    |                        |                      |        |               | 0740                 | 3                   | 0741                                  | 0                    | 0743               | 55.268 | 0744            | 0   | 0745 | 55.271 | 0746 | 0 |

|  | Situación actual 30/09/2017 | Situación cierre anual anterior 31/12/2016 | Situación inicial 26/03/2009 |      |      |      |
|--|-----------------------------|--|------------------------------|------|------|------|
| Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%) | 0747                        | 0,81                                       | 0748                         | 0,80 | 0749 | 2,00 |

S.05.2

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO C**

| (miles de euros) |                    | Situación actual 30/09/2017 |         |                  |         |                   |         |                  |        | Situación periodo comparativo anterior 30/09/2016 |         |                  |         |                   |         |                  |        |
|------------------|--------------------|-----------------------------|---------|------------------|---------|-------------------|---------|------------------|--------|---|---------|------------------|---------|-------------------|---------|------------------|--------|
| Serie            | Denominación serie | Amortización principal      |         |                  |         | Intereses         |         |                  |        | Amortización principal                            |         |                  |         | Intereses         |         |                  |        |
|                  |                    | Pagos del periodo           |         | Pagos acumulados |         | Pagos del periodo |         | Pagos acumulados |        | Pagos del periodo                                 |         | Pagos acumulados |         | Pagos del periodo |         | Pagos acumulados |        |
|                  |                    | 0750                        | 0751    | 0752             | 0753    | 1750              | 1751    | 1752             | 1753   |   |         |                  |         |                   |         |                  |        |
| ES0377957008     | SERIE A            | 0                           | 257.700 | 0                | 7.393   | 0                 | 257.700 | 0                | 7.393  | 0   | 257.700 | 0                | 7.393   | 0                 | 257.700 | 0                | 7.393  |
| ES0377957016     | SERIE B            | 2.560                       | 36.827  | 7                | 3.480   | 2.797             | 25.466  | 16               | 3.442  | 2.797   | 25.466  | 16               | 3.442   | 2.797             | 25.466  | 16               | 3.442  |
| ES0377957024     | SERIE C            | 0                           | 4.554   | 75               | 4.979   | 0                 | 4.554   | 79               | 4.678  | 0   | 4.554   | 79               | 4.678   | 0                 | 4.554   | 79               | 4.678  |
| ES0377957032     | SERIE D            | 0                           | 651     | 42               | 2.111   | 0                 | 651     | 43               | 1.945  | 0   | 651     | 43               | 1.945   | 0                 | 651     | 43               | 1.945  |
| <b>Total</b>     |                    | 0754                        | 2.560   | 0755             | 299.732 | 0756              | 124     | 0757             | 17.962 | 1754  | 2.797   | 1755             | 288.370 | 1756              | 137     | 1757             | 17.458 |

S.05.2

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO D**

| Serie        | Denominación Serie | Fecha último cambio de calificación crediticia | Agencia de calificación crediticia (2) | Calificación                |  |                              |
|--------------|--------------------|--|--|-----------------------------|--|------------------------------|
|              |                    |  |  | Situación actual 30/09/2017 | Situación cierre anual anterior 31/12/2016 | Situación inicial 26/03/2009 |
|              |                    |  |  | 0762                        | 0763                                       | 0764                         |
| ES0377957008 | SERIE A            | 31/07/2012                                     | FCH                                    | A                           | A  | AAA                          |
| ES0377957008 | SERIE A            | 12/06/2012                                     | SYP                                    | NR                          | NR   |                              |
| ES0377957016 | SERIE B            | 27/03/2009                                     | FCH                                    | A                           | A  | A                            |
| ES0377957016 | SERIE B            | 12/06/2012                                     | SYP                                    | NR                          | NR   |                              |
| ES0377957024 | SERIE C            | 06/07/2015                                     | FCH                                    | BB                          | BB   | BB                           |
| ES0377957024 | SERIE C            | 12/06/2012                                     | SYP                                    | NR                          | NR   |                              |
| ES0377957032 | SERIE D            | 06/07/2015                                     | FCH                                    | BB                          | BB   | B                            |
| ES0377957032 | SERIE D            | 12/06/2012                                     | SYP                                    | NR                          | NR   |                              |

S.05.2

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO E**

| Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros) | Principal pendiente         |               |  |               |                              |                |
|--|-----------------------------|---------------|--|---------------|------------------------------|----------------|
|  | Situación actual 30/09/2017 |               | Situación cierre anual anterior 31/12/2016 |               | Situación inicial 26/03/2009 |                |
| Inferior a 1 año   | 0765                        | 6.717         | 1765                                       | 7.441         | 2765                         | 36.152         |
| Entre 1 y 2 años   | 0766                        | 6.486         | 1766                                       | 7.010         | 2766                         | 32.014         |
| Entre 2 y 3 años   | 0767                        | 6.058         | 1767                                       | 6.730         | 2767                         | 31.629         |
| Entre 3 y 4 años   | 0768                        | 36.007        | 1768                                       | 6.143         | 2768                         | 27.190         |
| Entre 4 y 5 años   | 0769                        | 0             | 1769                                       | 36.407        | 2769                         | 22.746         |
| Entre 5 y 10 años  | 0770                        | 0             | 1770                                       | 0             | 2770                         | 93.915         |
| Superior a 10 años   | 0771                        | 0             | 1771                                       | 0             | 2771                         | 111.353        |
| <b>Total</b>   | <b>0772</b>                 | <b>55.268</b> | <b>1772</b>                                | <b>63.731</b> | <b>2772</b>                  | <b>355.000</b> |
| <b>Vida residual media ponderada (años)</b>  | <b>0773</b>                 | <b>3,19</b>   | <b>1773</b>                                | <b>4,23</b>   | <b>2773</b>                  | <b>17,26</b>   |

S.05.3

**Denominación Fondo:** TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:** Titulización de Activos, SGFT, S.A.

**Estados agregados:** NO

**Fecha:** 30/09/2017

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

| Información sobre las mejoras crediticias del Fondo  | Situación actual 30/09/2017 |                    | Situación cierre anual anterior 31/12/2016 |                    | Situación inicial 26/03/2009 |   |
|--|-----------------------------|--------------------|--|--------------------|------------------------------|---|
|  | Código                      | Valor              | Código                                     | Valor              | Código                       | Valor   |
| 1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)  | 0775                        | 36.832             | 1775                                       | 37.031             | 2775                         | 38.695  |
| 1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)   | 0776                        | 38.695             | 1776                                       | 38.695             | 2776                         | 38.695  |
| 1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)               | 0777                        | 66,64              | 1777                                       | 58,10              | 2777                         | 10,90   |
| 1.3 Denominación de la contrapartida   | 0778                        | Banco Mare Nostrum | 1778                                       | Banco Mare Nostrum | 2778                         | Caja de Ahorros y Monte de Piedad de las Baleares (SA NOSTRA) |
| 1.4 Rating de la contrapartida   | 0779                        |                    | 1779                                       |                    | 2779                         |   |
| 1.5 Rating requerido de la contrapartida   | 0780                        |                    | 1780                                       |                    | 2780                         |   |
| 2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)  | 0781                        |                    | 1781                                       |                    | 2781                         |   |
| 2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%) | 0782                        |                    | 1782                                       |                    | 2782                         |   |
| 2.2 Denominación de la contrapartida   | 0783                        |                    | 1783                                       |                    | 2783                         |   |
| 2.3 Rating de la contrapartida   | 0784                        |                    | 1784                                       |                    | 2784                         |   |
| 2.4 Rating requerido de la contrapartida   | 0785                        |                    | 1785                                       |                    | 2785                         |   |
| 3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)   | 0786                        |                    | 1786                                       |                    | 2786                         |   |
| 3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)                               | 0787                        |                    | 1787                                       |                    | 2787                         |   |
| 3.2 Denominación de la entidad avalista  | 0788                        |                    | 1788                                       |                    | 2788                         |   |
| 3.3 Rating del avalista  | 0789                        |                    | 1789                                       |                    | 2789                         |   |
| 3.4 Rating requerido del avalista  | 0790                        |                    | 1790                                       |                    | 2790                         |   |
| 4 Subordinación de series (S/N)  | 0791                        | S                  | 1791                                       | S                  | 2791                         | S   |
| 4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)  | 0792                        | 0,00               | 1792                                       | 0,00               | 2792                         | 72,59   |
| 5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)                          | 0793                        |                    | 1793                                       |                    | 2793                         |   |
| 5.1 Denominación de la contrapartida   | 0794                        |                    | 1794                                       |                    | 2794                         |   |
| 5.2 Rating de la contrapartida   | 0795                        |                    | 1795                                       |                    | 2795                         |   |
| 5.3 Rating requerido de la contrapartida   | 0796                        |                    | 1796                                       |                    | 2796                         |   |

S.05.3

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

| PERMUTAS FINANCIERAS |               | Importe a pagar por el fondo |  | Importe a pagar por la contrapartida  |   | Valor razonable (miles de euros)  |                             |  | Otras características        |      |
|----------------------|---------------|------------------------------|--|---|---|---|-----------------------------|--|------------------------------|------|
|                      | Contrapartida | Periodicidad liquidación     | Tipo de interés anual                                | Nocional  | Tipo de interés anual                   | Nocional  | Situación actual 30/09/2017 | Situación cierre anual anterior 31/12/2016 | Situación inicial 26/03/2009 |      |
|                      | 0800          | 0801                         | 0802   | 0803  | 0804                                    | 0805  | 0806                        | 1806                                       | 2806                         | 3806 |
| Swap de Bases        | BNP PARIBAS   | TRIMESTRAL                   | Media de los Euribor 12M en cada Fecha de Referencia | Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de los DC no Fallidas en base al periodo de revisión del tipo de interés (anual junto con tipo fijo, semestral y trimestral) | Tipo de Referencia de los Bonos - 0,15% | Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de los DC no Fallidas en base al periodo de revisión del tipo de interés (anual junto con tipo fijo, semestral y trimestral) | -667                        | -667                                       |                              |      |
| <b>Total</b>         |               |                              |  |   |   |   | 0808 -667                   | 0809 -667                                  | 0810                         |      |

S.05.3

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

| GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS<br>Naturaleza riesgo cubierto | Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros) |  |   |  |                              |  | Valor en libros (miles de euros) |  |   |  |                              |  | Otras características |  |
|--|---|--|---|--|------------------------------|--|----------------------------------|--|---|--|------------------------------|--|-----------------------|--|
|  | Situación actual<br>30/09/2017                      |  | Situación cierre anual<br>anterior 31/12/2016 |  | Situación inicial 26/03/2009 |  | Situación actual 30/09/2017      |  | Situación cierre anual<br>anterior 31/12/2016 |  | Situación inicial 26/03/2009 |  |                       |  |
| Préstamos hipotecarios                                       | 0811  |  | 1811  |  | 2811                         |  | 0829                             |  | 1829  |  | 2829                         |  | 3829                  |  |
| Cédulas hipotecarias   | 0812  |  | 1812  |  | 2812                         |  | 0830                             |  | 1830  |  | 2830                         |  | 3830                  |  |
| Préstamos a promotores                                       | 0813  |  | 1813  |  | 2813                         |  | 0831                             |  | 1831  |  | 2831                         |  | 3831                  |  |
| Préstamos a PYMES  | 0814  |  | 1814  |  | 2814                         |  | 0832                             |  | 1832  |  | 2832                         |  | 3832                  |  |
| Préstamos a empresas   | 0815  |  | 1815  |  | 2815                         |  | 0833                             |  | 1833  |  | 2833                         |  | 3833                  |  |
| Préstamos corporativos                                       | 0816  |  | 1816  |  | 2816                         |  | 0834                             |  | 1834  |  | 2834                         |  | 3834                  |  |
| Cédulas territoriales  | 0817  |  | 1817  |  | 2817                         |  | 0835                             |  | 1835  |  | 2835                         |  | 3835                  |  |
| Bonos de tesorería   | 0818  |  | 1818  |  | 2818                         |  | 0836                             |  | 1836  |  | 2836                         |  | 3836                  |  |
| Deuda subordinada  | 0819  |  | 1819  |  | 2819                         |  | 0837                             |  | 1837  |  | 2837                         |  | 3837                  |  |
| Créditos AAPP  | 0820  |  | 1820  |  | 2820                         |  | 0838                             |  | 1838  |  | 2838                         |  | 3838                  |  |
| Préstamos consumo  | 0821  |  | 1821  |  | 2821                         |  | 0839                             |  | 1839  |  | 2839                         |  | 3839                  |  |
| Préstamos automoción   | 0822  |  | 1822  |  | 2822                         |  | 0840                             |  | 1840  |  | 2840                         |  | 3840                  |  |
| Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)                 | 0823  |  | 1823  |  | 2823                         |  | 0841                             |  | 1841  |  | 2841                         |  | 3841                  |  |
| Cuentas a cobrar   | 0824  |  | 1824  |  | 2824                         |  | 0842                             |  | 1842  |  | 2842                         |  | 3842                  |  |
| Derechos de crédito futuros                                  | 0825  |  | 1825  |  | 2825                         |  | 0843                             |  | 1843  |  | 2843                         |  | 3843                  |  |
| Bonos de titulización  | 0826  |  | 1826  |  | 2826                         |  | 0844                             |  | 1844  |  | 2844                         |  |                       |  |
| <b>Total</b>   | 0827  |  | 1827  |  | 2827                         |  | 0845                             |  | 1845  |  | 2845                         |  | 3845                  |  |

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

**CUADRO A**

| Concepto  | Meses impago |    | Días impago |    | Importe impagado acumulado  |       |  |       | Ratio                       |      |  |      | Ref. Folleto |      |                   |                      |
|---|--------------|----|-------------|----|-----------------------------|-------|--|-------|-----------------------------|------|--|------|--------------|------|-------------------|----------------------|
|   |              |    |             |    | Situación actual 30/09/2017 |       | Situación cierre anual anterior 31/12/2016 |       | Situación actual 30/09/2017 |      | Situación cierre anual anterior 31/12/2016 |      |              |      | Última Fecha Pago |                      |
| 1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a  | 7000         |    | 7002        | 90 | 7003                        | 44    | 7006                                       | 248   | 7009                        | 0,08 | 7012                                       | 0,40 | 7015         | 0,08 |                   |                      |
| 2. Activos Morosos por otras razones                              |              |    |             |    | 7004                        |       | 7007                                       |       | 7010                        |      | 7013                                       |      | 7016         |      |                   |                      |
| Total Morosos   |              |    |             |    | 7005                        | 44    | 7008                                       | 248   | 7011                        | 0,08 | 7014                                       | 0,40 | 7017         | 0,08 | 7018              |                      |
| 3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a | 7019         | 12 | 7020        |    | 7021                        | 2.066 | 7024                                       | 2.186 | 7027                        | 3,64 | 7030                                       | 3,38 | 7033         | 3,60 |                   |                      |
| 4. Activos Fallidos por otras razones                             |              |    |             |    | 7022                        | 0     | 7025                                       | 0     | 7028                        | 0,00 | 7031                                       | 0,00 | 7034         | 0,00 |                   |                      |
| Total Fallidos  |              |    |             |    | 7023                        | 2.066 | 7026                                       | 2.186 | 7029                        | 3,64 | 7032                                       | 3,38 | 7035         | 3,60 | 7036              | Glosario de Términos |

| Otras ratios relevantes | Ratio                       |  |  | Ref. Folleto |      |
|-------------------------|-----------------------------|--|--|--------------|------|
|                         | Situación actual 30/09/2017 |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2016 |              |      |
|                         | 0850                        |  | 1850                                       |              | 3850 |
|                         | 0851                        |  | 1851                                       |              | 3851 |
|                         | 0852                        |  | 1852                                       |              | 3852 |
|                         | 0853                        |  | 1853                                       |              | 3853 |



S.05.4

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

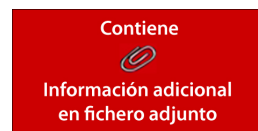
**CUADRO B**

| TRIGGERS   | Límite | % Actual | Última Fecha Pago | Referencia Folleto        |
|--|--------|----------|-------------------|---------------------------|
| <b>Amortización secuencial: series</b>               | 0854   | 0858     | 1858              | 2858                      |
| SERIE C - ES0377957024                               | 22,65  | 57,80    | 55,24             | 4.9.2.2.                  |
| SERIE D - ES0377957032                               | 10,00  | 15,39    | 15,58             | 4.9.2.2.                  |
| SERIE C - ES0377957024                               | 2,50   | 0,08     | 0,08              | 4.9.2.2.                  |
| SERIE D - ES0377957032                               | 2,00   | 0,08     | 0,08              | 4.9.2.2.                  |
| SERIE D - ES0377957032                               | 6,65   | 17,64    | 16,86             | 4.9.2.2.                  |
| SERIE C - ES0377957024                               | 10,00  | 15,39    | 15,58             | 4.9.2.2.                  |
| SERIE B - ES0377957016                               | 3,00   | 0,08     | 0,08              | 4.9.2.2.                  |
| SERIE B - ES0377957016                               | 10,00  | 15,39    | 15,58             | 4.9.2.2.                  |
| SERIE B - ES0377957016                               | 23,51  | 24,56    | 27,90             | 4.9.2.2.                  |
| <b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b> | 0855   | 0859     | 1859              | 2859                      |
| SERIE D - ES0377957032                               | 50,00  | 6,54     | 24,61             | 3.4.6.2.2.                |
| SERIE C - ES0377957024                               | 50,00  | 1,86     | 7,01              | 3.4.6.2.2.                |
| SERIE B - ES0377957016                               | 50,00  | 1,35     | 5,08              | 3.4.6.2.2.                |
| <b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>             | 0856   | 0860     | 1860              | 2860                      |
|  |        | 66,64    | 63,70             | 3.4.2.2. Modulo Adicional |
| <b>OTROS TRIGGERS</b>                                | 0857   | 0861     | 1861              | 2861                      |

Cuadro de texto libre

**CUADRO C**

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO A**

| Comisión                             | Contrapartida |                                       | Importe fijo (miles de euros) |    | Criterios determinación de la comisión |   |         |       | Máximo (miles de euros) |  | Mínimo (miles de euros) |  | Periodicidad pago según folleto / escritura |            | Condiciones iniciales folleto / escritura emisión |   | Otras consideraciones |  |
|--------------------------------------|---------------|---------------------------------------|-------------------------------|----|--|---|---------|-------|-------------------------|--|-------------------------|--|---|------------|---|---|-----------------------|--|
|                                      |               |                                       |                               |    | Base de cálculo                        |   | % anual |       |                         |  |                         |  |   |            |   |   |                       |  |
| Comisión sociedad gestora            | 0862          | Titulización de Activos, SGFT, S.A.   | 1862                          | 10 | 2862                                   |   | 3862    |       | 4862                    |  | 5862                    |  | 6862  | TRIMESTRAL | 7862  | S | 8862                  |  |
| Comisión administrador               | 0863          |                                       | 1863                          |    | 2863                                   |   | 3863    |       | 4863                    |  | 5863                    |  | 6863  |            | 7863  |   | 8863                  |  |
| Comisión del agente financiero/pagos | 0864          | BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, S.E. | 1864                          | 3  | 2864                                   | Saldo Nominal pendiente de vencimiento de los Derechos de Crédito agrupados en el Fondo en la Fecha de Pago inmediatamente anterior | 3864    | 0,003 | 4864                    |  | 5864                    |  | 6864  | TRIMESTRAL | 7864  | S | 8864                  |  |
| Otras                                | 0865          |                                       | 1865                          |    | 2865                                   |   | 3865    |       | 4865                    |  | 5865                    |  | 6865  |            | 7865  |   | 8865                  |  |

S.05.5

**Denominación Fondo:** TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:** Titulización de Activos, SGFT, S.A.

**Estados agregados:** NO

**Fecha:** 30/09/2017

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

| Forma de cálculo  |      |                           |
|---|------|---------------------------|
| 1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)                          | 0866 | N                         |
| 2 Diferencia cobros y pagos (S/N)                             | 0867 | S                         |
| 3 Otros (S/N)   | 0868 | N                         |
| 3.1 Descripción   | 0869 |                           |
| Contrapartida   | 0870 | Banco Mare Nostrum        |
| Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión) | 0871 | Módulo Adicional 3.4.3.2. |

| Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)  |      | Fecha cálculo |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | Total |  |  |
|---|------|---------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|-------|--|--|
| <b>Ingresos y gastos del periodo de cálculo</b>   | 0872 |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |  |
| Margen de intereses   | 0873 |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |  |
| Deterioro de activos financieros (neto)   | 0874 |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |  |
| Dotaciones a provisiones (neto)   | 0875 |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |  |
| Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta  | 0876 |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |  |
| Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)                                       | 0877 |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |  |
| <b>Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)</b> | 0878 |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |  |
| Impuesto sobre beneficios (-) (B)   | 0879 |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |  |
| Repercusión de ganancias (-) (C)  | 0880 |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |  |
| Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)   | 0881 |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |  |
| <b>Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]</b>   | 0882 |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |  |
| Comisión variable pagada  | 0883 |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |  |
| <b>Comisión variable impagada en el periodo de cálculo</b>  | 0884 |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |  |

S.05.5

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

| Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)    |      | Fecha cálculo |            |            |  |  |  |  |  | Total |   |
|--|------|---------------|------------|------------|--|--|--|--|--|-------|---|
|  |      | 28/03/2017    | 28/06/2017 | 28/09/2017 |  |  |  |  |  |       |   |
| Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto             | 0885 |               |            |            |  |  |  |  |  |       |   |
| Saldo inicial  | 0886 | 37.031        | 36.760     | 36.839     |  |  |  |  |  |       |   |
| Cobros del periodo   | 0887 | 2.981         | 3.153      | 2.746      |  |  |  |  |  |       |   |
| Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable | 0888 | -17           | -27        | -14        |  |  |  |  |  |       |   |
| Pagos por derivados  | 0889 | -66           | -62        | -55        |  |  |  |  |  |       |   |
| Retención importe Fondo de Reserva                               | 0890 | -36.760       | -36.839    | -36.832    |  |  |  |  |  |       |   |
| Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos              | 0891 | -3.169        | -2.985     | -2.683     |  |  |  |  |  |       |   |
| Pagos por deudas con entidades de crédito                        | 0892 | 0             | 0          | 0          |  |  |  |  |  |       |   |
| Resto pagos/retenciones  | 0893 | 0             | 0          | 0          |  |  |  |  |  |       |   |
| Saldo disponible   | 0894 | 0             | 0          | 0          |  |  |  |  |  |       |   |
| Liquidación de comisión variable                                 | 0895 | 0             | 0          | 0          |  |  |  |  |  |       | 0 |

S.06

Denominación Fondo: TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

**NOTAS EXPLICATIVAS**



**INFORME DE AUDITOR**

**INFORME SOBRE EL CUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE RIESGOS**