

TDA CAM 2, FTA

INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL MES DE MARZO DE 2012:
INFORMATION CORRESPONDING TO THE MONTH OF MARCH 2012:

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

* Saldo Vivo de Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión Hipotecarias a 01/03/12: <i>Outstanding Balance of the Mortgage Share Certificates and Mortgage Transfer Certificates on 01/03/12:</i>	279.440.124,38 €
* Saldo Vivo de Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión Hipotecarias a 31/03/12: <i>Outstanding Balance of the Mortgage Share Certificates and Mortgage Transfer Certificates on 31/03/12:</i>	276.852.847,20 €
* Tasa(1)de Amortización Anticipada (TAA) correspondiente al mes de MARZO: <i>Prepayment Rate(1)corresponding to the month of MARCH:</i>	1,98%
* TAA (12 meses)/ CPR (12 months):	3,39%
* Tipo de interés medio ponderado / <i>Weighted average interest rate:</i>	3,23%
* Vencimiento residual medio / <i>Weighted average maturity:</i>	11,34
* Vida Media bonos (TAA 10%) / <i>Average Life of bonds (CPR 10%) :</i>	
- Bonos A / <i>Bonds A:</i>	3,40
- Bonos B / <i>Bonds B:</i>	5,25
* Calificación Actual de los Bonos / <i>Current rating :</i>	
- Bonos A / <i>Bonds A:</i>	(M) Aa2(sf) / (F) AAA(sf)
- Bonos B / <i>Bonds B:</i>	(M) A2(sf) / (F) AA-(sf)
* Información Deposito Garantía por la bajada de calificación de la contrapartida del Swap : <i>Information on the Protection Deposit constituted due the downgrade of the Swap counterparty:</i>	
- Importe depositado / <i>Amount of the deposit:</i>	0,00 €
- Fecha de constitución del Depósito / <i>Deposit Incorporation Date:</i>	18-abr-12
- Fecha de valoración del Depósito / <i>Deposit Valuation Date:</i>	26-abr-12
- Metodo de Cálculo / <i>Calculation Method:</i>	Max[0;Mtm+((1,25)*(1+Max[0%;5%*(WAL-20)])*VC*Notional)]
- Periodicidad de Valoración / <i>Valuation frequency:</i>	Semanal / Weekly

La Sociedad Gestora, para facilitar a los inversores la valoración de los Bonos, suministra a demanda los flujos de pago previstos durante la vida del Bono, bajo diversas hipótesis alternativas de TAA.
In order to facilitate the evaluation of the Bonds for the investors, the Sociedad Gestora will supply upon request the projected cashflows for the life of the Bond, under different prepayment scenarios.

(1) Tasa Anualizada
(1) *Annualized Rate*

Nº: 2646/12
TDA CAM 2/Info.mensualMar12