

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8853
NIF Fondo: V85219772
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: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	204.889	1001	227.149
I. Activos financieros a largo plazo	0002	204.889	1002	227.149
1. Activos titulizados	0003	204.889	1003	227.149
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	166.292	1004	184.750
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	35.881	1005	39.567
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	0	1010	0
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	2.724	1025	2.839
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-7	1027	-7
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
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

S.01

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	36.218	1041	37.590
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	17.591	1043	18.283
1. Activos titulizados	0044	17.427	1044	18.122
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	14.021	1045	14.660
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	2.789	1046	2.861
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	0	1051	0
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	162	1065	196
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	16	1066	16
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	421	1067	376
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	21	1068	21
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-1	1069	-7
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	164	1074	160
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	164	1077	159
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	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	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	18.627	1085	19.307
1. Tesorería	0086	18.627	1086	19.307
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	241.107	1088	264.739

S.01

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	226.749	1089	249.625
I. Provisiones a largo plazo	0090	4.224	1090	4.767
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	4.224	1092	4.767
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	222.525	1094	244.858
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	209.593	1095	230.957
1.1 Series no subordinadas	0096	193.314	1096	213.097
1.2 Series subordinadas	0097	16.279	1097	17.860
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	9.980	1101	10.950
2.1 Préstamo subordinado	0102	9.980	1102	10.950
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	0	1105	0
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	2.951	1108	2.951
3.1 Derivados de cobertura	0109	2.951	1109	2.951
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
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) PASIVO CORRIENTE	0117	18.151	1117	18.828
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	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
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	18.136	1123	18.808
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	17.261	1124	17.931
1.1 Series no subordinadas	0125	17.230	1125	17.897
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	31	1128	35
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	12	1131	13
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	12	1136	13
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	863	1139	863
3.1 Derivados de cobertura	0140	863	1140	863
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
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	15	1148	20
1. Comisiones	0149	11	1149	10
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	7	1150	7
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	4	1152	4
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	5	1157	10
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-3.793	1158	-3.714
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-3.793	1160	-3.714
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	241.107	1162	264.739

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	1.043	1201	1.366	2201	3.391	3201	4.451
1.1 Activos titulizados	0202	1.043	1202	1.366	2202	3.391	3202	4.451
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-80	1204	-95	2204	-234	3204	-429
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-45	1205	-64	2205	-138	3205	-347
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-17	1206	-21	2206	-53	3206	-71
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-17	1207	-11	2207	-42	3207	-11
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-191	1208	-297	2208	-635	3208	-880
A) MARGEN DE INTERESES	0209	772	1209	974	2209	2.523	3209	3.142
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	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
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-1.162	1217	-18	2217	-3.071	3217	-58
7.1 Servicios exteriores	0218	-3	1218	-2	2218	-27	3218	-12
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-3	1219	-2	2219	-27	3219	-12
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	-1.159	1224	-16	2224	-3.045	3224	-47
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-11	1225	-12	2225	-35	3225	-35
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	-1.144	1228	0	2228	-2.998	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
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-4	1231	5	2231	5	3231	5
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-4	1232	5	2232	5	3232	5
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	394	1234	-961	2234	543	3234	-3.089
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	394	1236	-961	2236	543	3236	-3.089
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238	0	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	0	2239	0	3239	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-396	1300	374	2300	-570	3300	-471
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	763	1301	953	2301	2.475	3301	3.032
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.049	1302	1.384	2302	3.426	3302	4.507
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-46	1303	-86	2303	-142	3303	-469
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	-208	1305	-314	2305	-714	3305	-918
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	-17	1307	-22	2307	-55	3307	-78
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-16	1308	-10	2308	-41	3308	-10
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-1.159	1309	-579	2309	-3.044	3309	-3.503
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-12	1310	-12	2310	-35	3310	-35
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	-1.144	1313	-563	2313	-2.998	3313	-3.457
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	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) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	130	1322	1.765	2322	-111	3322	585
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	456	1325	2.116	2325	891	3325	1.729
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	4.091	1326	4.232	2326	12.510	3326	12.970
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	3.450	1327	5.369	2327	9.605	3327	13.276
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	194	1328	444	2328	807	3328	1.094
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	-7.279	1331	-7.929	2331	-22.030	3331	-25.611
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-326	1332	-351	2332	-1.002	3332	-1.144
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	-320	1334	-349	2334	-969	3334	-1.127
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-6	1336	-2	2336	-32	3336	-17
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-267	1337	2.139	2337	-680	3337	114
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	18.893	1338	20.553	2338	19.307	3338	22.578
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	18.627	1339	22.691	2339	18.627	3339	22.691

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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
1. Activos financieros disponibles para la venta								
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
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-208	1357	-314	2357	-714	3357	-918
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-208	1358	-314	2358	-714	3358	-918
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	191	1360	297	2360	635	3360	880
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	16	1362	17	2362	79	3362	38
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
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
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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	1,23	0400	0,00	0420	0,00	0440	5,32	1380	1,06	1400	0,00	1420	0,00	1440	6,27	2380	0,00	2400	0,00	2420	0,00	2440	12,00
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	2,28	0401	0,00	0421	0,00	0441	4,57	1381	2,48	1401	0,00	1421	0,00	1441	5,05	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	12,00
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		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
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: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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	101	0467	29	0474	10	0481	0	0488	39	0495	7.974	0502	0	0509	8.013
De 1 a 3 meses	0461	22	0468	19	0475	6	0482	0	0489	25	0496	1.703	0503	0	0510	1.728
De 3 a 6 meses	0462	4	0469	5	0476	2	0483	1	0490	8	0497	271	0504	0	0511	278
De 6 a 9 meses	0463	4	0470	5	0477	1	0484	1	0491	8	0498	223	0505	0	0512	231
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	34	0472	147	0479	17	0486	36	0493	200	0500	2.494	0507	0	0514	2.695
Total	0466	165	0473	205	0480	37	0487	38	0494	280	0501	12.665	0508	0	1515	12.945

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	101	0522	29	0529	10	0536	0	0543	39	0550	7.974	0557	0	0564	8.013	0571	22.137	0578	22.137	0584	36,20
De 1 a 3 meses	0516	22	0523	19	0530	6	0537	0	0544	25	0551	1.703	0558	0	0565	1.728	0572	5.669	0579	5.669	0585	30,48
De 3 a 6 meses	0517	4	0524	5	0531	2	0538	1	0545	8	0552	271	0559	0	0566	278	0573	960	0580	960	0586	28,97
De 6 a 9 meses	0518	4	0525	5	0532	1	0539	1	0546	8	0553	223	0560	0	0567	231	0574	650	0581	650	0587	35,47
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	34	0527	147	0534	17	0541	36	0548	200	0555	2.494	0562	0	0569	2.695	0576	8.306	0583	8.306	0589	32,44
Total	0521	165	0528	205	0535	37	0542	38	0549	280	0556	12.665	0563	0	0570	12.945	0577	37.721			0590	34,32

S.05.1

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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 25/09/2007	
Inferior a 1 año	0600	426	1600	351	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	983	1601	1.121	2601	29
Entre 2 y 3 años	0602	1.462	1602	1.635	2602	172
Entre 3 y 4 años	0603	2.866	1603	2.184	2603	1.182
Entre 4 y 5 años	0604	3.301	1604	3.382	2604	1.876
Entre 5 y 10 años	0605	32.949	1605	33.050	2605	31.419
Superior a 10 años	0606	180.141	1606	203.328	2606	715.322
Total	0607	222.127	1607	245.053	2607	750.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	14,58	1608	15,15	2608	22,77

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 25/09/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	13,01	1609	12,28	2609	3,04

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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 D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 25/09/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	2.577	0630	104.427	1620	2.639	1630	107.535	2620	2.898	2630	164.622
40% - 60%	0621	1.028	0631	100.284	1621	1.143	1631	112.632	2621	1.790	2631	189.164
60% - 80%	0622	118	0632	17.068	1622	168	1632	23.686	2622	2.403	2632	343.133
80% - 100%	0623	2	0633	348	1623	6	1633	1.200	2623	301	2633	53.081
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
Total	0628	3.725	0638	222.127	1628	3.956	1638	245.053	2628	7.392	2638	750.000
Media ponderada (%)	0639	39,43	0649		1639	40,84	1649		2639	57,39	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 25/09/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	2,03	1650	2,23	2650	4,79
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,68	1651	4,95	2651	6,61
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	2,69

S.05.1

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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 25/09/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	1	0683	28	1660	1	1683	29	2660	1	2683	45
Aragón	0661	70	0684	3.495	1661	75	1684	3.857	2661	183	2684	15.913
Asturias	0662	0	0685	0	1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663	2	0686	139	1663	2	1686	148	2663	4	2686	425
Canarias	0664	0	0687	0	1664	0	1687	0	2664	1	2687	40
Cantabria	0665	0	0688	0	1665	0	1688	0	2665	0	2688	0
Castilla-León	0666	0	0689	0	1666	0	1689	0	2666	1	2689	100
Castilla La Mancha	0667	1	0690	12	1667	1	1690	13	2667	1	2690	28
Cataluña	0668	3.612	0691	216.279	1668	3.837	1691	238.678	2668	7.118	2691	726.028
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	1	2693	70
Galicia	0671	0	0694	0	1671	0	1694	0	2671	0	2694	0
Madrid	0672	5	0695	288	1672	5	1695	307	2672	31	2695	3.345
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	0	0697	0	1674	1	1697	0	2674	1	2697	34
Navarra	0675	0	0698	0	1675	0	1698	0	2675	0	2698	0
La Rioja	0676	1	0699	15	1676	1	1699	26	2676	1	2699	97
Comunidad Valenciana	0677	33	0700	1.870	1677	33	1700	1.995	2677	49	2700	3.875
País Vasco	0678	0	0701	0	1678	0	1701	0	2678	0	2701	0
Total España	0679	3.725	0702	222.127	1679	3.956	1702	245.053	2679	7.392	2702	750.000
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
Total general	0682	3.725	0705	222.127	1682	3.956	1705	245.053	2682	7.392	2705	750.000

S.05.1
Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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 25/09/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,59			1710	1,49			2710	0,74		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

S.05.2

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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 25/09/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0347598007	SERIE A	7.263	28.989	210.545	7.263	31.804	230.994	7.263	100.000	726.300			
ES0347598015	SERIE B	72	68.688	4.946	72	75.359	5.426	72	100.000	7.200			
ES0347598023	SERIE C	165	68.688	11.334	165	75.359	12.434	165	100.000	16.500			
Total		0723	7.500	0724	226.824	1723	7.500	1724	248.854	2723	7.500	2724	750.000

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
						0730	0731		0732	0733	0734	0735			0742	0736	0737
ES0347598007	SERIE A	NS	EURIBOR 3 m	0,30	0,00	0	0	SI	210.545	0	0	0	210.545	0			
ES0347598015	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,60	0,27	2	0	SI	4.946	0	0	0	4.948	0			
ES0347598023	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	1,75	1,42	29	0	SI	11.334	0	0	0	11.362	0			
Total						0740	31	0741	0	0743	226.824	0744	0	0745	226.855	0746	0

	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 25/09/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,08	0748	0,13	0749	0,00

S.05.2
Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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								
ES0347598007	SERIE A	6.757	515.755	0	79.485	7.360	485.986	30	79.484								
ES0347598015	SERIE B	159	2.254	3	1.184	173	1.555	5	1.168								
ES0347598023	SERIE C	364	5.166	42	4.517	396	3.564	50	4.339								
Total		0754	7.279	0755	523.176	0756	46	0757	85.186	1754	7.929	1755	491.105	1756	86	1757	84.991

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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 25/09/2007
				0762	0763	0764
ES0347598007	SERIE A	06/07/2016	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0347598007	SERIE A	28/04/2016	SYP	BBB+	BBB+	AAA
ES0347598015	SERIE B	06/07/2016	MDY	Baa1	Baa1	Aa2
ES0347598015	SERIE B	28/04/2016	SYP	BBB+	BBB+	AA
ES0347598023	SERIE C	06/07/2016	MDY	B1	B1	Baa2
ES0347598023	SERIE C	21/01/2015	SYP	BB-	BB-	BBB+

S.05.2

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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 25/09/2007	
Inferior a 1 año	0765	19.475	1765	19.436	2765	27.133
Entre 1 y 2 años	0766	16.554	1766	17.352	2766	23.166
Entre 2 y 3 años	0767	16.288	1767	17.033	2767	23.916
Entre 3 y 4 años	0768	15.980	1768	16.789	2768	24.864
Entre 4 y 5 años	0769	15.512	1769	16.439	2769	25.829
Entre 5 y 10 años	0770	69.057	1770	74.302	2770	140.239
Superior a 10 años	0771	73.958	1771	87.503	2771	484.853
Total	0772	226.824	1772	248.854	2772	750.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	10,08	1773	11,33	2773	35,10

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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 25/09/2007	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	9.980	1775	10.950	2775	16.500
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	9.980	1776	10.950	2776	16.500
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	4,40	1777	4,40	2777	2,20
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Banco Sabadell	1778	Banco Sabadell	2778	Caixa de Estalvis del Penedes
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	92,81	1792	92,82	2792	96,84
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: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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 25/09/2007	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	JP MORGAN SECURITIES PLC	TRIMESTRAL	Media de los Euribor 12M en cada Fecha de Referencia	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de las PH y CTH no Fallidas	Tipo de Referencia de los Bonos - 0,068%	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de las PH y CTH no Fallidas	-3.814	-3.814		
Total							0808 -3.814	0809 -3.814	0810	

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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 Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 25/09/2007		Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 25/09/2007			
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			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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	517	7006	275	7009	0,24	7012	0,11	7015	0,15		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	517	7008	275	7011	0,24	7014	0,11	7017	0,15	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	2.998	7024	3.175	7027	1,35	7030	1,30	7033	1,31		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	2.998	7026	3.175	7029	1,35	7032	1,30	7035	1,31	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

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
SERIE C - ES0347598023	1,00	0,23	0,15	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE B - ES0347598015	1,25	0,23	0,15	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE C - ES0347598023	4,40	5,00	5,00	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE B - ES0347598015	10,00	29,62	30,65	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE B - ES0347598015	1,92	2,18	2,18	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE C - ES0347598023	10,00	29,62	30,65	Nota de Valores 4.9.2.2
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0347598023	5,00	2,14	2,13	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE B - ES0347598015	7,42	2,14	2,13	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		4,40	4,40	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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		2862	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las Participaciones y Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,013	4862		5862	10	6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	Société Générale, Sucursal en España	1864	4	2864		3864		4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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 Sabadell
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		
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	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														
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878														
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879														
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880														
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881														
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882														
Comisión variable pagada	0883														
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884														

S.05.5

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, 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
		30/01/2017	28/04/2017	28/07/2017		
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885					
Saldo inicial	0886	10.950	10.640	10.301		
Cobros del periodo	0887	8.516	8.788	8.713		
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-35	-24	-20		
Pagos por derivados	0889	-277	-229	-208		
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-10.640	-10.301	-9.980		
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-7.089	-7.758	-7.325		
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-329	-357	-338		
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0		
Saldo disponible	0894	1.095	760	1.144		
Liquidación de comisión variable	0895	1.095	760	1.144		2.998

S.06

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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