

TDA IBERCAJA 2 - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 26/04/16 - 26/07/16

	Euros
I. Situación al 26/04/16:	4.500.000,00
Saldo inicial Cta. Reinversión	4.500.000,00
II. Fondos recibidos del emisor	9.034.425,67
Principal:	
Según calendario hasta 30/06/16:	6.205.285,01
Amort. Anticipada hasta 30/06/16:	2.186.949,16
Intereses:	642.191,50
III. Recursos disponibles (I + II):	13.534.425,67
IV. Total intereses de la reinversión:	0,00
Intereses Cta. Reinversión	0,00
Intereses Cta. Tesorería	0,00
V. Recursos disponibles (III + IV):	13.534.425,67
VI. Varios:	28.951,71
VII. Liquidación SWAP:	-297.438,56
Cantidad a Pagar por la Parte A (Fondo):	642.191,50
Cantidad a Pagar por la Parte B (Credit Suisse):	344.752,94
VIII. Pago a los Bonos:	8.459.330,55
Bonos A:	
Intereses correspondientes al 26/07/16:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 26/07/16:	7.854.718,59
Bonos B:	
Intereses correspondientes al 26/07/16:	625,32
Retenciones practicadas a los bonos:	-118,81
Amortización correspondiente al 26/07/16:	361.921,32
Bonos C:	
Intereses correspondientes al 26/07/16:	2.147,67
Retenciones practicadas a los bonos:	-408,06
Amortización correspondiente al 26/07/16:	118.140,12
Bonos D:	
Intereses correspondientes al 26/07/16:	7.912,59
Retenciones practicadas a los bonos:	-1.503,39
Amortización correspondiente al 26/07/16:	76.884,84
Bonos E:	
Intereses correspondientes al 26/07/16:	36.980,10
Retenciones practicadas a los bonos:	-7.026,22
Amortización correspondiente al 26/07/16:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	9.056,48
IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII):	4.748.704,85
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva 26/04/16:	4.500.000,00
Margen de intermediación financiera	248.704,85
Fondo de Reserva 26/07/16:	4.500.000,00

Destinatarios: CNMV; AIAF



Nº: 3448/16

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Orense, 69
28020 Madrid
Tel.:917020808
<http://www.tda-sgft.com>
TDAIBERCAJA2liq.tmm/Uu16

TD A IBERCAJA 2

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 26 de Julio de 2016

Importes en euros		
I. BONOS A ES0338451000		
	Sobre 8703 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/10/05):	870.300.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	255.624.080,85 €	29.371,95 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	7.854.718,59 €	902,53 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	247.769.362,26 €	28.469,42 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	28,469420%	28,469420%
II. BONOS B ES0338451018		
	Sobre 193 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/10/05):	19.300.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	11.778.369,26 €	61.027,82 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	625,32 €	3,24 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	361.921,32 €	1.875,24 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	11.416.447,94 €	59.152,58 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	59,152580%	59,152580%
III. BONOS C ES0338451026		
	Sobre 63 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/10/05):	6.300.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	3.844.752,66 €	61.027,82 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	2.147,67 €	34,09 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	118.140,12 €	1.875,24 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	3.726.612,54 €	59.152,58 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	59,152580%	59,152580%
IV. BONOS D ES0338451034		
	Sobre 41 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/10/05):	4.100.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	2.502.140,62 €	61.027,82 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	7.912,59 €	192,99 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	76.884,84 €	1.875,24 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	2.425.255,78 €	59.152,58 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	59,152580%	59,152580%
V. BONOS E ES0338451042		
	Sobre 45 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/10/05):	4.500.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	4.500.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	36.980,10 €	821,78 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	4.500.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
VI. EL FONDO		
Importes en euros		
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 30/06/16:		
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:		265.337.694,17 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:		1.541.509,80 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:		265.563.726,50 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:		2.051.175,53 €
2. Amortización del período 31/03/16 a 30/06/16:		
a) Según calendario:		6.205.285,01 €
b) Amortización anticipada hasta 30/06/16:		2.186.949,16 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):		
a) Ultimo año:		3,41%
b) Ultimo semestre:		3,30%
c) Ultimo trimestre:		3,16%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:		
0,78%		
5. Porcentaje de impago entre 7 y 17 meses:		
0,32%		
6. Porcentaje de fallidos (1):		
0,77%		
7. Nivel de Impago (2):		
0,42%		

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 18 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de las Participaciones Hipotecarias impagadas durante el período de tiempo comprendido entre el segundo y el noveno mes inmediatamente anteriores a la correspondiente Fecha de Pago respecto al saldo nominal pendiente de las Participaciones Hipotecarias

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF.



Nº: 3449/16

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

http://www.tda-sgft.com

TD A IBERCAJA2\Infoinver.trim\Jul16

TDA IBERCAJA 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 26/04/16 - 26/07/16

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO	
Fecha de Constitución del Fondo	13 de octubre de 2005
Fecha Emisión BTH	13 de octubre de 2005
Fecha Final Amortización Bonos (teórica) (3,41% TAA)	26 de julio de 2023
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Emisor Participaciones Hipotecarias	Ibercaja Banco
Agente de Pagos	Société Générale, Sucursal en España
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Moody's Investors Service España S.A Standard & Poor's
Calificación	Bono A: (M) Aa3 (sf) / (S&P) BBB (sf) Bono B: (M) Baa3 (sf) / (S&P) BB+ (sf) Bono C: (M) Ba3 (sf) / (S&P) BB (sf) Bono D: (M) B2 (sf) / (S&P) B+ (sf) Bono E: (M) Ca (sf) / (S&P) -
II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO	
Nombre	Bonos de Titulización TDA IBERCAJA 2
Serie A:	
Código ISIN	ES0338451000
Nominal en circulación total (inicial)	870.300.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	247.769.362,26 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	28.469,42 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0338451018
Nominal en circulación total (inicial)	19.300.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	11.416.447,94 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	59.152,58 Euros

TDA IBERCAJA 2\INFO.trim\Jul16

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)	
Nombre	Bonos de Titulización TDA IBERCAJA 2
Serie C:	
Código ISIN	ES0338451026
Nominal en circulación total (inicial)	6.300.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	3.726.612,54 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	59.152,58 Euros
Serie D:	
Código ISIN	ES0338451034
Nominal en circulación total (inicial)	4.100.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	2.425.255,78 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	59.152,58 Euros
Serie E:	
Código ISIN	ES0338451042
Nominal en circulación total (inicial)	4.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	4.500.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA
* Liquidación del Período: 26/04/16 - 26/07/16
* Flujos de Caja del Período: 26/04/16 - 26/07/16
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 26 de Julio de 2016

TDA IBERCAJA 2**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 26/04/16 - 26/07/16:**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip. Amortización Participaciones Hip.	8.392.234,17	8.411.664,87
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH Intereses recibidos de las PHs Intereses Inversiones Temporales	642.191,50 0,00	47.665,68
III. GASTOS		
Comisiones Periódicas: Neto SWAP Margen de intermediación financiera		28.951,71 297.438,56 248.704,85
Total Ingresos/Pagos	9.034.425,67	9.034.425,67
Saldo inicial 26/04/16 A Inversiones Temporales	4.500.000,00	4.500.000,00
Total	13.534.425,67	13.534.425,67
Retenciones practicadas: A inversiones temporales	9.056,48	9.056,48

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 3455/16**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

<http://www.tda-sgft.com>

TDAIBERCAJA2fluj.trimJul16