

TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2 - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 28/06/18 - 28/09/18

	Euros
	BANKIA (SA NOSTRA)
I. Situación al 28/06/18:	36.776.957,14
Fondo de Reserva	36.776.957,14
II. Fondos recibidos del emisor	2.227.876,13
Principal:	
Según calendario hasta 31/08/18:	1.538.241,77
Amort. Anticipada hasta 31/08/18:	580.839,57
Intereses:	108.794,79
III. Total intereses de la reinversión:	-1.551,09
Intereses cta. Reinversion	0,00
Intereses cta. Cobros	-614,78
Intereses cta. Tesorería	-936,31
IV. Recursos disponibles (I + II + III):	39.003.282,18
V. Gastos:	14.213,48
VI. Liquidación SWAP:	-35.615,63
Cantidad a Pagar por la Parte A (BNP Paribas):	-58.755,56
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	-23.139,93
VII. Pago a los Bonos:	2.241.510,19
Bonos B:	
Intereses correspondientes al 28/09/18:	3.124,80
Retenciones practicadas a los bonos:	-593,71
Amortización correspondiente al 28/09/18:	2.120.922,72
Bonos C:	
Intereses correspondientes al 28/09/18:	75.682,75
Retenciones practicadas a los bonos:	-14.379,72
Amortización correspondiente al 28/09/18:	0,00
Bonos D:	
Intereses correspondientes al 28/09/18:	41.779,92
Retenciones practicadas a los bonos:	-7.938,18
Amortización correspondiente al 28/09/18:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones :	22.911,61
VIII. Saldo disponible (IV - V + VI - VII):	36.711.942,88
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo 28/06/18:	36.776.957,14
Aportación al Fondo de Reserva	-65.014,26
Remuneración Fija del Préstamo Participativo	0,00
Intereses Préstamo Subordinado	0,00
Amortización Préstamo Participativo	0,00
Amortización Préstamo Subordinado	0,00
Remuneración Variable del Préstamo Participativo	0,00
Fondo de Reserva a 28/09/18:	36.711.942,88

Destinatarios: CNMV; AIAF



Nº: 3952/18

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2\liq.trim\Sep18

TD A SA NOSTRA EMPRESAS 2

Fondo de Titulización de Activos

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 28 de Septiembre de 2018

Importes en euros

I. BONOS B ES0377957016	Sobre 504 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (31/03/09):	50.400.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	6.912.102,96 €	13.714,49 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	3.124,80 €	6,20 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	2.120.922,72 €	4.208,18 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	4.791.180,24 €	9.506,31 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	9,506310%	9,506310%
II. BONOS C ES0377957024	Sobre 365 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (31/03/09):	36.500.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	31.946.489,95 €	87.524,63 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	75.682,75 €	207,35 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	31.946.489,95 €	87.524,63 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	87,524630%	87,524630%
III. BONOS D ES0377957032	Sobre 104 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (31/03/09):	10.400.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	9.748.816,48 €	93.738,62 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	41.779,92 €	401,73 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	9.748.816,48 €	93.738,62 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	93,738620%	93,738620%
IV. EL FONDO	Importes en euros	
1. Saldo de los derechos de credito a 31/08/18:		
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:		46.486.487,14 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:		1.414.736,78 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:		46.567.490,37 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:		1.913.993,81 €
2. Amortización del período 31/05/18 a 31/08/18:		2.119.081,34 €
a) Según calendario:		1.538.241,77 €
b) Amortización anticipada hasta 31/08/18:		580.839,57 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):		
a) Ultimo año:		3,96%
b) Ultimo semestre:		4,44%
c) Ultimo trimestre:		4,69%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:		0,41%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:		0,23%
6. Porcentaje de fallidos (1):		3,95%
7. Nivel de Impago (2)		0,29%

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 12 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de las Participaciones Hipotecarias con morosidad superior a 90 días en la Fecha de Cobroinmediata anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

Destinatarios: CNMV; AIAF, Agente de Pagos



Nº: 3953/18

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.
Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

http://www.tda-sgft.com

TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2\Infoinver.trim\Sep18

TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2 , FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 28/06/18 - 28/09/18

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO	
Fecha de Constitución del Fondo	27 de marzo de 2009
Fecha Emisión BTH	27 de marzo de 2009
Fecha Final Amortización BTH: (3,96% TAA)	29 de junio de 2020
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca	Bankia (Sa Nostra)
Agente de Pagos	BNP PARIBAS
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Fitch Ratings España
Calificación	Bonos B: (F) A (sf) Bonos C: (F) BBB- (sf) Bonos D: (F) BBB- (sf)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO	
Nombre	Bonos de Titulización TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2
Serie B:	
Código ISIN	ES0377957016
Nominal en circulación total (inicial)	50.400.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	4.791.180,24 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	9.506,31 Euros

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)	
Nombre	Bonos de Titulización TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2
Serie C:	
Código ISIN	ES0377957024
Nominal en circulación total (inicial)	36.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	31.946.489,95 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	87.524,63 Euros
Serie D:	
Código ISIN	ES0377957032
Nominal en circulación total (inicial)	10.400.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	9.748.816,48 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	93.738,62 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA
* Liquidación del Período: 28/06/18 - 28/09/18
* Flujos de Caja del Período: 28/06/18 - 28/09/18
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 28 de Septiembre de 2018

TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2*Fondo de Titulización de Activos***FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 28/06/18 - 28/09/18**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	Ingresos	Pagos
Amortización Bonos Titulización Hip. Amortización Derechos de Credito Amortización Ptmos. Subordinados	2.119.081,34	2.120.922,72 0,00
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH Intereses recibidos de las PHs Intereses Ptmos. Subordinados Intereses Inversiones Temporales	108.794,79 -1.551,09	120.587,47 0,00
III. GASTOS		
Comisiones y Gastos: Neto SWAP a favor de la Parte A (BNP Paribas) Remuneración Variable del Prestamo Participativo		14.213,48 35.615,63 0,00
Total Ingresos/Pagos	2.226.325,04	2.291.339,30
Saldo inicial FR a 28/06/18 A Inversiones Temporales (FR)	36.776.957,14	36.711.942,88
Total	39.003.282,18	39.003.282,18
Retenciones practicadas el 28/09/18 A inversiones financieras temporales	22.911,61	22.911,61

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 3960/18**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA SA NOSTRA EMPRESAS 2\fluj.trim\Sep18