

IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA

Información correspondiente al periodo: 25/01/2016 - 25/04/2016

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	29/06/2006
Fecha de Desembolso de los Bonos	04/07/2006
Agente Financiero	Société Générale S.E.
Negociación Mercado	Bolsa de Valores de Barcelona

Calificación Actual (*)	Fitch
Bonos A(S) (Completamente Amortizado)	
Bonos A(G)	BBB (sf)
Bonos B	CCC (sf)
Bonos C	CC (sf)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Serie A(S) (Completamente Amortizado)		Serie A(G)	
Código ISIN	ES0347842009	Código ISIN	ES0347842017
Nominal en circulación total (inicial)	202.800.000,00 €	Nominal en circulación total (inicial)	271.700.000,00 €
Nominal en circulación total (actual)	0,00 €	Nominal en circulación total (actual)	34.316.470,76 €
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 €	Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 €
Nominal en circulación unitario (actual)	0,00 €	Nominal en circulación unitario (actual)	12.630,28 €
Serie B		Serie C	
Código ISIN	ES0347842025	Código ISIN	ES0347842033
Nominal en circulación total (inicial)	19.800.000,00 €	Nominal en circulación total (inicial)	5.700.000,00 €
Nominal en circulación total (actual)	19.800.000,00 €	Nominal en circulación total (actual)	5.700.000,00 €
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 €	Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 €
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 €	Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 €

III. INFORMACIÓN INCLUIDA

Liquidación correspondiente al periodo: 25/01/2016 - 25/04/2016

Anuncio del Pago de los Bonos: 25/04/2016

Flujos de Caja del periodo: 25/01/2016 - 25/04/2016

 (*) Calificación correspondiente a la fecha 05/04/2016. La calificación actualizada de los Bonos se puede consultar en nuestra página web www.imtitulizacion.com.

IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA
Liquidación del Periodo: 25/01/2016 - 25/04/2016
Fecha de Pago: 25/04/2016

Recursos Disponibles (I+II+III+IV+V):	14.757.229,18			
I. Situación Inicial:	9.500.000,00			
II. Fondos recibidos del cedente:	5.257.229,18			
a) Principal regular	4.392.370,98			
b) Recuperación de Fallidos	83.098,44			
c) Intereses ordinarios	382.444,30			
d) Intereses de demora	0,00			
e) Amortización Anticipada	399.315,46			
III. Otros:	0,00			
IV. Intereses de las Cuentas:	0,00			
V. Cobro de la Liquidación del Swap:	0,00			
Aplicación de Fondos (Ref. 3.4.6.3 del Módulo Adicional)	Aplicado	Devengado en esta Fecha de Pago	Debido en la Fecha de Pago anterior	Debido tras esta Fecha de Pago
(i) Gastos periódicos:	15.602,67	15.602,67	0,00	0,00
(ii) Pago, en su caso, de la cantidad neta a pagar del Contrato de Permuta Financiera, y solamente en caso de resolución del contrato por circunstancias imputables a la Parte A, la cantidad neta que corresponda al pago liquidativo:	292.255,80	292.255,80	0,00	0,00
(iii) Pago de intereses devengados de los Bonos de la Serie A(G), debidos y no pagados en Fechas de Pago anteriores y reembolso a la Generalitat de los importes dispuestos y no reembolsados del Aval:	0,00	0,00	0,00	0,00
Pago de intereses devengados de los Bonos de la Serie A(S), debidos y no pagados en Fechas de Pago anteriores y reembolso a la Generalitat de los importes dispuestos y no reembolsados del Aval (completamente amortizada):	0,00	0,00	0,00	0,00
(iv) Pago de intereses de los Bonos de la Serie A(S) y A(G) devengados desde la Fecha de Pago anterior:				
Serie A(S) (completamente amortizada):	0,00	0,00	0,00	0,00
Serie A(G):	0,00	0,00	0,00	0,00
(v) Pago de intereses de los Bonos de la Serie B si no concurren las circunstancias que determinan su posposición al número (viii) del Orden de Prelación de Pagos:	12.713,58	12.713,58	0,00	0,00
(vi) Pago de intereses de los Bonos de la Serie C si no concurren las circunstancias que determinan su posposición al número (ix) del Orden de Prelación de Pagos:	7.982,28	7.982,28	0,00	0,00
(vii) Retención de la Cantidad Disponible para amortización :				
Amortización de la Serie A (S) (completamente amortizada)	0,00	0,00	0,00	0,00
Amortización de la Serie A (G)	4.791.701,20	4.791.701,20	0,00	0,00
Amortización de la Serie B	0,00	0,00	0,00	0,00
Amortización de la Serie C	0,00	0,00	0,00	0,00
(viii) Pago de intereses de los Bonos de la Serie B, si concurren las circunstancias que determinan su posposición a este número del Orden de Prelación de Pagos:	0,00	0,00	0,00	0,00
(ix) Pago de intereses de los Bonos de la Serie C, si concurren las circunstancias que determinan su posposición a este número del Orden de Prelación de Pagos:	0,00	0,00	0,00	0,00
(x) Dotación del Fondo de Reserva hasta que alcance su Nivel Mínimo:	9.500.000,00	9.500.000,00	-	0,00
(xi) Pago de intereses del Préstamo para el Fondo de Reserva:	136.973,65	32.514,81	1.304.814,87	1.200.356,03
(xii) Amortización del Préstamo para Fondo de Reserva:	0,00	0,00	0,00	0,00
(xiii) Pago de la cantidad a pagar por resolución de la Permuta Financiera de Intereses excepto en los supuestos contemplados en el lugar (ii) anterior:	0,00	0,00	0,00	0,00
(xiv) Pago de intereses del Préstamo para Gastos Iniciales:	0,00	422,16	21.424,64	21.846,80
(xv) Amortización del Préstamo para Gastos Iniciales:	0,00	0,00	195.559,82	195.559,82
(xvi) Pago de la Comisión de Administración:	0,00	1.615,20	146.823,36	148.438,56
(xvii) Margen de Intermediación:	0,00	0,00	0,00	0,00
Total	14.757.229,18	14.654.807,70	1.668.622,69	1.566.201,21

IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA

Liquidación del Período: 25/01/2016 - 25/04/2016

Fecha de Pago: 25/04/2016

Detalle del cálculo de la amortización de los Bonos	
Cantidad Disponible para Amortización (Mínimo entre 1 y 2 siguientes)	4.791.694,05
1. Cantidad Teórica de Amortización (Diferencia entre A y B siguientes):	4.791.694,05
A) Saldo Nominal Pendiente de los Bonos en Fecha de Pago anterior.	64.608.171,96
B) Saldo nominal pendiente de los préstamos no fallidos	59.816.477,91
2. Fondos Disponibles menos los conceptos (i) al (vi)	14.428.674,85
Cantidad Aplicada	4.791.701,20
Resto por redondeo	-7,15
Déficit de Principal	0,00

Información sobre Impagados y Fallidos:	
Impago de principal	
Trimestre anterior	94.670,23
Trimestre actual	160.980,20
Importe de Fallidos del Periodo	0,00

Detalle del cálculo del Nivel Mínimo Requerido del Fondo de Reserva:		
Información de Triggers: Reducción del Nivel Mínimo del Fondo de Reserva.		No Cumple Condición
Conceptos	%	Importe
1. % Saldo Inicial de los Bonos	1,900	9.500.000,00
2. % Saldo Actual de los Bonos	3,800	2.273.025,89
3. Importe mínimo		3.750.000,00
Nivel Mínimo Requerido=Max(3,Min(1,2)) (*)		9.500.000,00
Dotación del Fondo de Reserva		9.500.000,00
Deficit del Fondo de Reserva		0,00

(*) El Nivel Mínimo del Fondo de Reserva, en el caso de no cumplirse las condiciones para su reducción, será igual al importe del Nivel Mínimo del Fondo de Reserva correspondiente a la Fecha de Pago anterior.

Otros Pasivos:				
Préstamos Subordinados	Saldo Inicial	Saldo Nominal Pendiente	Saldo vivo no vencido	Cupón
Préstamo para el Fondo de Reserva	9.500.000,00	9.500.000,00	9.500.000,00	1,354 %
Préstamo para Gastos Iniciales	434.577,50	195.559,82	0,00	0,854 %

IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA

Anuncio de Pago

Fecha de Pago: 25/04/2016

	Serie A(G)	Serie B
Cod. ISIN	ES0347842017	ES0347842025
Periodo de Devengo	25/01/2016 - 25/04/2016	25/01/2016 - 25/04/2016
Tipo de Referencia Vigente	-0,146 %	-0,146 %
Margen	0,045 %	0,400 %
Cupón Vigente	0,000 %	0,254 %

	TOTAL	POR BONO	TOTAL	POR BONO
Saldo Inicial	271.700.000,00	100.000,00	19.800.000,00	100.000,00
Saldo Inicial Antes del Pago	39.108.171,96	14.393,88	19.800.000,00	100.000,00
Pago de Principal	4.791.701,20	1.763,60	0,00	0,00
Principal debido	0,00	0,00	0,00	0,00
Saldo Final después del Pago	34.316.470,76	12.630,28	19.800.000,00	100.000,00
% Pendiente de vencimiento actual	12,63 %	12,63 %	100,00 %	100,00 %
Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago	0,00	0,00	0,00	0,00
Interés Bruto Devengado	0,00	0,00	12.713,58	64,21
Interés Bruto Pagado	0,00	0,00	12.713,58	64,21
Interés Bruto Debido	0,00	0,00	0,00	0,00
Retención (19%)	0,00	0,00	2.415,60	12,20
Interés Neto	0,00	0,00	10.297,98	52,01

	Serie C
Cod. ISIN	ES0347842033
Periodo de Devengo	25/01/2016 - 25/04/2016
Tipo de Referencia Vigente	-0,146 %
Margen	0,700 %
Cupón Vigente	0,554 %

	TOTAL	POR BONO
Saldo Inicial	5.700.000,00	100.000,00
Saldo Inicial Antes del Pago	5.700.000,00	100.000,00
Pago de Principal	0,00	0,00
Principal debido	0,00	0,00
Saldo Final después del Pago	5.700.000,00	100.000,00
% Pendiente de vencimiento actual	100,00 %	100,00 %
Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago	0,00	0,00
Interés Bruto Devengado	7.982,28	140,04
Interés Bruto Pagado	7.982,28	140,04
Interés Bruto Debido	0,00	0,00
Retención (19%)	1.516,77	26,61
Interés Neto	6.465,51	113,43

ES0347842009 (SERIE A(S)) Amortizada el 24/01/2011

Nota: La retención se devolverá, en su caso, de acuerdo con la legislación vigente.

Nota: En aquellos casos en los que el resultado de la fórmula de fijación del tipo de interés de los Bonos es inferior a cero, la Sociedad Gestora ha fijado el Tipo de Interés Nominal para este Periodo de Devengo de Intereses en el 0%.

IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA
Flujos de Caja del Periodo: 25/01/2016 - 25/04/2016

Concepto	Importe	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
<u>I. Principal</u>	<u>4.874.784,88</u>	<u>4.791.701,20</u>
Amortización Derechos de Crédito	4.874.784,88	
Amortización Bonos de Titulización		4.791.701,20
Amortización Préstamos Subordinados		0,00
<u>II. Intereses</u>	<u>484.842,87</u>	<u>552.323,88</u>
Intereses cobrados Derechos de Crédito	382.444,30	
Intereses de las cuentas	0,00	
Otros	0,00	
Contrato de Swap	102.398,57	394.654,37
Intereses pagados a los Bonos de Titulización		20.695,86
Intereses de Préstamos Subordinados		136.973,65
<u>III. Gastos</u>	<u>0,00</u>	<u>15.602,67</u>
TOTAL INGRESOS/PAGOS	5.359.627,75	5.359.627,75
Saldo Inicial 25/01/2016	9.500.000,00	
Recursos depositados para la próxima Fecha de Pago		
Fondo de Reserva		9.500.000,00
TOTAL	14.859.627,75	14.859.627,75
Retenciones Practicadas el 25/04/2016	3.932,37	
A Inversiones Temporales hasta el 20/05/2016		3.932,37