

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: 30/09/2020

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: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	124.758	1001	140.255
I. Activos financieros a largo plazo	0002	124.758	1002	140.255
1. Activos titulizados	0003	124.758	1003	140.255
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	102.401	1004	113.523
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	22.040	1005	24.761
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	318	1025	1.971
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	0
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: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	26.618	1041	28.898
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	12.999	1043	14.267
1. Activos titulizados	0044	12.766	1044	14.189
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	10.546	1045	11.306
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	2.049	1046	2.206
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	82	1065	95
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	5	1066	7
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	82	1067	560
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	1	1068	15
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	0	1069	0
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	234	1074	78
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	227	1077	78
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	7	1079	0
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	13.619	1085	14.631
1. Tesorería	0086	13.619	1086	14.631
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	151.376	1088	169.153

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	139.368	1089	155.710
I. Provisiones a largo plazo	0090	822	1090	3.224
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	822	1092	3.224
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	138.546	1094	152.485
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	129.652	1095	143.591
1.1 Series no subordinadas	0096	119.437	1096	132.275
1.2 Series subordinadas	0097	10.215	1097	11.315
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	8.250	1101	8.250
2.1 Préstamo subordinado	0102	8.250	1102	8.250
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	645	1108	645
3.1 Derivados de cobertura	0109	645	1109	645
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

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: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) PASIVO CORRIENTE	0117	13.050	1117	14.452
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	13.038	1123	14.436
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	12.695	1124	14.092
1.1 Series no subordinadas	0125	12.677	1125	14.072
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	17	1128	20
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	8	1131	9
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	8	1136	9
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	335	1139	335
3.1 Derivados de cobertura	0140	335	1140	335
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	12	1148	16
1. Comisiones	0149	11	1149	11
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	1	1157	5
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-1.042	1158	-1.009
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-1.042	1160	-1.009
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	151.376	1162	169.153

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	545	1201	668	2201	1.753	3201	2.099
1.1 Activos titulizados	0202	545	1202	668	2202	1.753	3202	2.099
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-68	1204	-59	2204	-209	3204	-202
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-39	1205	-31	2205	-123	3205	-126
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-13	1206	-14	2206	-42	3206	-28
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-16	1207	-14	2207	-44	3207	-48
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-68	1208	-117	2208	-204	3208	-297
A) MARGEN DE INTERESES	0209	409	1209	492	2209	1.341	3209	1.599
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	-457	1217	-708	2217	-3.743	3217	-2.337
7.1 Servicios exteriores	0218	-2	1218	-3	2218	-15	3218	-23
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-2	1219	-3	2219	-15	3219	-23
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	-455	1224	-705	2224	-3.728	3224	-2.315
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-12	1225	-12	2225	-36	3225	-36
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	-439	1228	-689	2228	-3.681	3228	-2.268
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	0	1231	0	2231	0	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	0	2232	0	3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	48	1234	216	2234	2.402	3234	738
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	48	1236	216	2236	2.402	3236	738
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: 30/09/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-19	1300	-186	2300	-2.402	3300	-669
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	436	1301	519	2301	1.326	3301	1.646
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	548	1302	672	2302	1.782	3302	2.123
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-69	1303	-33	2303	-126	3303	-107
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	-10	1305	-92	2305	-236	3305	-279
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	-14	2307	-42	3307	-43
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-16	1308	-14	2308	-51	3308	-48
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-455	1309	-705	2309	-3.728	3309	-2.315
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-12	1310	-12	2310	-36	3310	-36
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	-439	1313	-689	2313	-3.681	3313	-2.268
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	421	1322	-1.631	2322	1.390	3322	-982
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	427	1325	-1.624	2325	1.409	3325	-847
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	2.962	1326	3.474	2326	9.491	3326	10.622
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.901	1327	1.022	2327	4.828	3327	15.006
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	57	1328	473	2328	2.423	3328	1.224
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	-4.493	1331	-6.594	2331	-15.334	3331	-27.699
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-6	1332	-7	2332	-19	3332	-136
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	0	1334	0	2334	0	3334	-109
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-6	1336	-7	2336	-19	3336	-27
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	402	1337	-1.817	2337	-1.012	3337	-1.652
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	13.217	1338	15.475	2338	14.631	3338	15.310
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	13.619	1339	13.658	2339	13.619	3339	13.658

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
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	-10	1357	-92	2357	-236	3357	-279
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-10	1358	-92	2358	-236	3358	-279
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	68	1360	117	2360	204	3360	297
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	-58	1362	-26	2362	33	3362	-18
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: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2020								Situación cierre anual anterior 31/12/2019								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	0,32	0400	0,00	0420	0,00	0440	4,48	1380	1,67	1400	0,00	1420	0,00	1440	9,91	2380	0,00	2400	0,00	2420	0,00	2440	12,00
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	0,14	0401	0,00	0421	0,00	0441	6,05	1381	1,49	1401	0,00	1421	0,00	1441	10,02	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: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

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	50	0467	15	0474	3	0481	0	0488	18	0495	3.279	0502	0	0509	3.297
De 1 a 3 meses	0461	9	0468	5	0475	2	0482	0	0489	7	0496	487	0503	0	0510	494
De 3 a 6 meses	0462	1	0469	1	0476	0	0483	0	0490	1	0497	2	0504	0	0511	3
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	4	0477	0	0484	0	0491	4	0498	108	0505	0	0512	112
De 9 a 12 meses	0464	4	0471	16	0478	0	0485	1	0492	17	0499	160	0506	0	0513	178
Más de 12 meses	0465	5	0472	22	0479	1	0486	2	0493	25	0500	86	0507	0	0514	112
Total	0466	70	0473	63	0480	6	0487	3	0494	72	0501	4.123	0508	0	1515	4.196

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	50	0522	15	0529	3	0536	0	0543	18	0550	3.279	0557	0	0564	3.297	0571	10.913	0578	10.913	0584	30,21
De 1 a 3 meses	0516	9	0523	5	0530	2	0537	0	0544	7	0551	487	0558	0	0565	494	0572	2.077	0579	2.077	0585	23,79
De 3 a 6 meses	0517	1	0524	1	0531	0	0538	0	0545	1	0552	2	0559	0	0566	3	0573	205	0580	205	0586	1,59
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	4	0532	0	0539	0	0546	4	0553	108	0560	0	0567	112	0574	330	0581	330	0587	33,90
De 9 a 12 meses	0519	4	0526	16	0533	0	0540	1	0547	17	0554	160	0561	0	0568	178	0575	667	0582	667	0588	26,66
Más de 12 meses	0520	5	0527	22	0534	1	0541	2	0548	25	0555	86	0562	0	0569	112	0576	840	0583	840	0589	13,30
Total	0521	70	0528	63	0535	6	0542	3	0549	72	0556	4.123	0563	0	0570	4.196	0577	15.032			0590	27,91

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: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 25/09/2007	
Inferior a 1 año	0600	352	1600	507	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	896	1601	1.019	2601	29
Entre 2 y 3 años	0602	1.830	1602	1.745	2602	172
Entre 3 y 4 años	0603	2.199	1603	2.584	2603	1.182
Entre 4 y 5 años	0604	3.153	1604	2.999	2604	1.876
Entre 5 y 10 años	0605	28.387	1605	30.125	2605	31.419
Superior a 10 años	0606	100.618	1606	115.348	2606	715.322
Total	0607	137.435	1607	154.327	2607	750.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	12,41	1608	12,89	2608	22,77

Antigüedad	Situación actual 30/09/2020					
	Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 25/09/2007			
Antigüedad media ponderada (años)	0609	15,90	1609	15,17	2609	3,04

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: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				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	2.220	0630	86.684	1620	2.291	1630	89.675	2620	2.898	2630	164.622
40% - 60%	0621	500	0631	46.378	1621	613	1631	58.394	2621	1.790	2631	189.164
60% - 80%	0622	30	0632	4.373	1622	46	1632	6.258	2622	2.403	2632	343.133
80% - 100%	0623	0	0633	0	1623	0	1633	0	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	2.750	0638	137.435	1628	2.950	1638	154.327	2628	7.392	2638	750.000
Media ponderada (%)	0639	33,52	0649		1639	34,93	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: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 25/09/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,58	1650	1,66	2650	4,79
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,40	1651	4,68	2651	6,61
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	2,69

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				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	19	1660	1	1683	21	2660	1	2683	45
Aragón	0661	58	0684	2.428	1661	62	1684	2.730	2661	183	2684	15.913
Asturias	0662	0	0685	0	1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663	1	0686	97	1663	1	1686	103	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	8	1667	1	1690	9	2667	1	2690	28
Cataluña	0668	2.656	0691	133.458	1668	2.850	1691	149.794	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	3	0695	186	1672	3	1695	197	2672	31	2695	3.345
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	0	0697	0	1674	0	1697	0	2674	1	2697	34
Navarra	0675	0	0698	0	1675	0	1698	0	2675	0	2698	0
La Rioja	0676	0	0699	0	1676	1	1699	0	2676	1	2699	97
Comunidad Valenciana	0677	30	0700	1.240	1677	31	1700	1.473	2677	49	2700	3.875
País Vasco	0678	0	0701	0	1678	0	1701	0	2678	0	2701	0
Total España	0679	2.750	0702	137.435	1679	2.950	1702	154.327	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	2.750	0705	137.435	1682	2.950	1705	154.327	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: 30/09/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 25/09/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	2,14			1710	1,99			2710	0,74		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

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: 30/09/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			Situación inicial 25/09/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0347598007	SERIE A	7.263	18.190	132.114	7.263	20.150	146.347	7.263	100.000	726.300			
ES0347598015	SERIE B	72	43.101	3.103	72	47.744	3.438	72	100.000	7.200			
ES0347598023	SERIE C	165	43.101	7.112	165	47.744	7.878	165	100.000	16.500			
Total		0723	7.500	0724	142.329	1723	7.500	1724	157.663	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: 30/09/2020

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	132.114	0	0	0	132.114	0			
ES0347598015	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,60	0,15	1	0	SI	3.103	0	0	0	3.104	0			
ES0347598023	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	1,75	1,30	16	0	SI	7.112	0	0	0	7.128	0			
Total						0740	17	0741	0	0743	142.329	0744	0	0745	142.347	0746	0

	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 25/09/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,10	0748	0,08	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: 30/09/2020
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2020								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2019							
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	4.170	594.186	37	79.522	6.120	575.677	0	79.485								
ES0347598015	SERIE B	98	4.097	3	1.217	144	3.662	3	1.208								
ES0347598023	SERIE C	224	9.388	29	4.918	329	8.392	31	4.808								
Total		0754	4.493	0755	607.671	0756	69	0757	85.658	1754	6.594	1755	587.731	1756	33	1757	85.501

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: 30/09/2020

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 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 25/09/2007
				0760	0761	0762
ES0347598007	SERIE A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0347598007	SERIE A	26/04/2019	SYP	AA-	AA-	AAA
ES0347598015	SERIE B	24/02/2020	MDY	Aa3	A3	Aa2
ES0347598015	SERIE B	26/04/2019	SYP	A+	A+	AA
ES0347598023	SERIE C	24/02/2020	MDY	Baa2	Ba1	Baa2
ES0347598023	SERIE C	30/04/2018	SYP	BBB	BBB	BBB+

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: 30/09/2020

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 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 25/09/2007	
Inferior a 1 año	0765	14.436	1765	15.203	2765	27.133
Entre 1 y 2 años	0766	12.660	1766	13.467	2766	23.166
Entre 2 y 3 años	0767	12.257	1767	13.043	2767	23.916
Entre 3 y 4 años	0768	11.757	1768	12.571	2768	24.864
Entre 4 y 5 años	0769	11.270	1769	12.035	2769	25.829
Entre 5 y 10 años	0770	79.948	1770	91.345	2770	140.239
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	484.853
Total	0772	142.329	1772	157.663	2772	750.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	5,33	1773	6,58	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: 30/09/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 25/09/2007	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	8.250	1775	8.250	2775	16.500
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	8.250	1776	8.250	2776	16.500
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	5,80	1777	5,23	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	92,81	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: 30/09/2020

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 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	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		-980		
Total							0808	0809	-980	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: 30/09/2020

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 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 25/09/2007		Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		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: 30/09/2020

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 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	182	7006	474	7009	0,13	7012	0,31	7015	0,22		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	182	7008	474	7011	0,13	7014	0,31	7017	0,22	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	222	7024	2.316	7027	0,16	7030	1,50	7033	0,09		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	222	7026	2.316	7029	0,16	7032	1,50	7035	0,09	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	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: 30/09/2020

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	10,00	18,32	19,00	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE C - ES0347598023	1,00	0,13	0,22	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	1,92	2,18	2,18	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE B - ES0347598015	10,00	18,32	19,00	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE B - ES0347598015	1,25	0,13	0,22	Nota de Valores 4.9.2.2
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0347598015	7,42	2,27	2,27	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE C - ES0347598023	5,00	2,27	2,27	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		5,80	5,62	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: 30/09/2020

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: 30/09/2020

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														

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo				Total
		28/01/2020	28/04/2020	28/07/2020		
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885					
Saldo inicial	0886	8.250	8.250	8.250		
Cobros del periodo	0887	6.456	7.979	5.051		
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-27	-18	-23		
Pagos por derivados	0889	-128	-98	-10		
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-8.250	-8.250	-8.250		
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-5.723	-5.175	-4.562		
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-13	-13	-17		
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0		
Saldo disponible	0894	566	2.675	439		
Liquidación de comisión variable	0895	566	2.675	439		3.681

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: 30/09/2020

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