

**IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA  
LIQUIDACIÓN ANTICIPADA**

**Información correspondiente al período: 26/07/2016 - 24/10/2016**

**I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO**

Fecha de Constitución del Fondo	29/06/2006
Fecha de Desembolso de los Bonos	04/07/2006
Sociedad Gestora	InterMoney Titulización, SGFT, S.A.
Cedente de los Derechos de Crédito	Banco Sabadell
Agente Financiero	Société Générale Sucursal en España
Negociación Mercado	Bolsa de Valores de Barcelona
Agencia de Calificación	Fitch Ratings
Calificación Actual Bonos	
Bonos A(S)	Completamente amortizado
Bonos A(G)	Completamente amortizado
Bonos B	Completamente amortizado
Bonos C	Completamente amortizado

**II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO**

<b>Serie A(S)</b> Código ISIN	<b>ES0347842009</b> Completamente amortizado
<b>Serie A(G)</b> Código ISIN	<b>ES0347842017</b> Completamente amortizado
<b>Serie B</b> Código ISIN	<b>ES0347842025</b> Completamente amortizado
<b>Serie C</b> Código ISIN	<b>ES0347842033</b> Completamente amortizado

**III. INFORMACIÓN INCLUIDA**

Liquidación correspondiente al período: 26/07/2016 - 24/10/2016

Anuncio del Pago de los Bonos: 24/10/2016

Flujos de Caja del período: 26/07/2016 - 24/10/2016

IMT/IM FTGENCAT SABADELL2/Info Pago/LIQUIDACIÓN ANTICIPADA

Destinatario: CNMV.

**IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA**  
**LIQUIDACIÓN ANTICIPADA**  
**Liquidación del Período: 26/07/2016 - 24/10/2016**  
**Fecha de Pago: 24/10/2016**

<i>Concepto</i>	<i>Importe</i>
<b><u>RECURSOS DISPONIBLES</u></b>	
<b>I. Situación inicial:</b>	<b>3.750.000,00</b>
Saldo inicial de las Cuentas	3.750.000,00
<b>II. Fondos recibidos del emisor ( II.1 + II.2 ):</b>	<b>4.527.045,86</b>
II.1 Principal cobrado de los Derechos de Crédito	4.224.761,69
Según calendario	3.860.503,61
Recuperación de Fallidos	67.901,01
Amortización Anticipada	296.357,07
II.2 Intereses cobrados de los Derechos de Crédito	302.284,17
<b>III. Subtotal de la Cuenta de Tesorería (I + II):</b>	<b>8.277.045,86</b>
<b>IV. Intereses de las cuentas:</b>	<b>-6.171,79</b>
<b>V. Cobro de la Liquidación del Swap:</b>	<b>0,00</b>
<b>VI. Importe de la venta de los Derechos de Crédito:</b>	<b>57.214.615,52</b>
<b>VII. Fondos Disponibles para la Liquidación Anticipada del Fondo (III + IV + V + VI):</b>	<b>65.485.489,59</b>
<b><u>PAGOS</u></b>	
<b>(i) Reserva para hacer frente a los gastos finales de extinción y liquidación de orden tributario, administrativo o publicitario (1):</b>	<b>17.650,00</b>
<b>(ii) Gastos periódicos:</b>	<b>26.557,99</b>
<b>(iii) 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:</b>	<b>223.118,33</b>
<b>(iv) Pago de intereses devengados de los Bonos de las Series A(S) y 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:</b>	<b>0,00</b>
<b>(v) Pago de intereses de las Series A(S) y A(G):</b>	<b>0,00</b>
<b>Serie A(S)</b>	<b>Amortizada</b>
<b>Serie A(G)</b>	
Intereses debidos en la Fecha de Pago anterior	0,00
Intereses devengados en esta Fecha de Pago	0,00
Interés pagado	0,00
Interés debido	0,00
Retenciones practicadas a los bonos (2)	0,00
<b>(vi) Amortización de los Bonos de la Serie A(S):</b>	<b>Amortizada</b>
<b>(vii) Amortización de los Bonos de la Serie A(G):</b>	<b>34.316.470,76</b>
<b>(viii) Amortización a prorrata de los Bonos de la Serie A(S), A(G) y reembolso a la Generalitat de las disposiciones del Aval:</b>	<b>0,00</b>

<b>(ix) Pago de intereses de la Serie B:</b>	<b>3.239,28</b>
Intereses debidos en la Fecha de Pago anterior	0,00
Intereses devengados en esta Fecha de Pago	3.239,28
Interés pagado	3.239,28
Interés debido	0,00
Retenciones practicadas a los bonos (2)	-615,78
<b>(x) Amortización de los Bonos de la Serie B:</b>	<b>12.581.335,80</b>
<b>(xi) Pago de intereses de la Serie C:</b>	<b>5.742,75</b>
Intereses debidos en la Fecha de Pago anterior	0,00
Intereses devengados en esta Fecha de Pago	5.742,75
Interés pagado	5.742,75
Interés debido	0,00
Retenciones practicadas a los bonos (2)	-1.090,98
<b>(xii) Amortización de los Bonos de la Serie C:</b>	<b>5.700.000,00</b>
<b>(xiii) Pago de intereses del Préstamo para el Fondo de Reserva:</b>	<b>12.449,93</b>
Intereses debidos en la Fecha de Pago anterior	0,00
Intereses devengados en esta Fecha de Pago	12.449,93
Interés pagado	12.449,93
Interés debido	0,00
<b>(xiv) Amortización del Préstamo para Fondo de Reserva:</b>	<b>4.139.628,00</b>
Amortización debida en la anterior Fecha de Pago	389.628,00
Amortización correspondiente a esta Fecha de Pago	3.750.000,00
Amortización pagada	4.139.628,00
Amortización debida	0,00
<b>(xv) Pago de intereses del Préstamo para Gastos Iniciales:</b>	<b>22.565,82</b>
Intereses debidos en la Fecha de Pago anterior	22.222,12
Intereses devengados en esta Fecha de Pago	343,70
Interés pagado	22.565,82
Interés debido	0,00
<b>(xvi) Amortización del Préstamo para Gastos Iniciales:</b>	<b>195.559,82</b>
Amortización debida en la anterior Fecha de Pago	195.559,82
Amortización correspondiente a esta Fecha de Pago	0,00
Amortización pagada	195.559,82
Amortización debida	0,00
<b>(xvii) Pago de la cantidad a pagar por resolución de la Permuta Financiera de Intereses excepto en los supuestos contemplados en el lugar (iii) anterior:</b>	<b>0,00</b>
<b>(xviii) Pago de la Comisión de Administración:</b>	<b>151.248,92</b>
Comisión de administración debida en la anterior Fecha de Pago	149.933,97
Comisión de administración devengada en esta Fecha de Pago	1.314,95
Comisión de administración pagada	151.248,92
Comisión de administración debida	0,00
<b>(xix) Margen de Intermediación:</b>	<b>8.089.922,19</b>

(1) Hemos incluido en este epígrafe una estimación de 4.000 euros para el pago de los intereses devengados en el mes de octubre en la Cuenta de Tesorería del Fondo y que serán cargados en dicha cuenta una vez transcurrida la Fecha de Pago.

(2) Reinvertido hasta el 21/11/2016

Información sobre Impagados y Fallidos

Impago de principal	
Trimestre anterior	20.256,32
Trimestre actual	17.407,06
Importe de Fallidos del Período	0,00

IMT/IM FTGENCAT SABADELL2/Pago/Liquidación Anticipada

Destinatarios: Emisor; CNMV

**IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA**  
**LIQUIDACIÓN ANTICIPADA**  
**ANUNCIO DE PAGO**  
**FECHA DE PAGO: 24/10/2016**

Cod. ISIN	SERIE A(G)		SERIE B		SERIE C	
	ES0347842017		ES0347842025		ES0347842033	
Periodo de Devengo	26/07/2016	24/10/2016	26/07/2016	24/10/2016	26/07/2016	24/10/2016
Tipo de Referencia Vigente	-0,297%		-0,297%		-0,297%	
Margen	0,045%		0,400%		0,700%	
Cupón vigente	0,000%		0,103%		0,403%	
Tipo Mínimo	-		-		-	
	<b>TOTAL</b>	<b>POR BONO</b>	<b>TOTAL</b>	<b>POR BONO</b>	<b>TOTAL</b>	<b>POR BONO</b>
Saldo Inicial	271.700.000,00	100.000,00	19.800.000,00	100.000,00	5.700.000,00	100.000,00
Saldo Inicial Antes del Pago	34.316.470,76	12.630,28	12.581.335,80	63.542,10	5.700.000,00	100.000,00
Pago de Principal	34.316.470,76	12.630,28	12.581.335,80	63.542,10	5.700.000,00	100.000,00
Saldo Final después del Pago	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
% Pendiente de vencimiento actual	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Interés Bruto Devengado	0,00	0,00	3.239,28	16,36	5.742,75	100,75
Interés Bruto Pagado	0,00	0,00	3.239,28	16,36	5.742,75	100,75
Interés Bruto Debido	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Retención (19%)	0,00	0,00	615,78	3,11	1.090,98	19,14
Interés Neto	0,00	0,00	2.623,50	13,25	4.651,77	81,61

IMT/IM FTGENCAT SABADELL 2/ Anuncio Pago/LIQUIDACIÓN ANTICIPADA

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 Período de Devengo de Intereses en el 0%.

**IM FTGENCAT SABADELL 2, FTA**  
**LIQUIDACIÓN ANTICIPADA**  
**Flujos de Caja del Período: 26/07/2016 - 24/10/2016**

<b>Concepto</b>	<b>Importe</b>	
	<b><u>Ingresos</u></b>	<b><u>Pagos</u></b>
<b><u>I. Principal</u></b>	<b><u>61.439.377,21</u></b>	<b><u>56.932.994,38</u></b>
Amortización de los Derechos de Crédito	4.224.761,69	
Amortización Bonos de Titulización		52.597.806,56
Amortización Préstamos Subordinados		4.335.187,82
Importe de la venta de los Derechos de Crédito	57.214.615,52	
<b><u>II. Intereses</u></b>	<b><u>370.801,27</u></b>	<b><u>341.805,00</u></b>
Intereses cobrados de los Derechos de Crédito	302.284,17	
Intereses de las cuentas	-6.171,79	
Contrato de Swap	74.688,89	297.807,22
Intereses pagados a los Bonos de Titulización		8.982,03
Intereses de Préstamos Subordinados		35.015,75
<b><u>III. Reserva para hacer frente a los gastos finales de extinción y liquidación de orden tributario, administrativo o publicitario</u></b>		<b><u>17.650,00</u></b>
<b><u>III. Gastos periódicos</u></b>	<b><u>0,00</u></b>	<b><u>8.267.729,10</u></b>
<b>TOTAL INGRESOS/ PAGOS</b>	<b>61.810.178,48</b>	<b>65.560.178,48</b>
Saldo Inicial de la Cuenta Tesorería 26/07/2016	3.750.000,00	
Recursos depositados para la próxima Fecha de Pago: Fondo de Reserva		0,00
<b>TOTAL</b>	<b>65.560.178,48</b>	<b>65.560.178,48</b>
Retenciones Practicadas el 24/10/2016	1.706,76	
A Inversiones Temporales hasta el 21/11/2016		1.706,76

IMT/IM FTGENCAT SABADELL2/Fluj Trim/LIQUIDACIÓN ANTICIPADA

Destinatarios: CNMV.