

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: 30/06/2022

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)

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	92.662	1001	101.210
I. Activos financieros a largo plazo	0002	92.662	1002	101.210
1. Activos titulizados	0003	92.662	1003	101.210
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	75.426	1004	82.686
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	16.728	1005	17.960
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	508	1025	564
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: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	24.187	1041	25.304
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	10.990	1043	11.321
1. Activos titulizados	0044	10.850	1044	11.310
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	8.841	1045	9.274
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	1.813	1046	1.851
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	53	1065	59
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	3	1066	3
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	137	1067	120
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	4	1068	3
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	140	1074	11
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	133	1077	4
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	7	1079	6
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	13.197	1085	13.983
1. Tesorería	0086	13.197	1086	13.983
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	116.849	1088	126.514

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: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	106.162	1089	115.347
I. Provisiones a largo plazo	0090	1.087	1090	847
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	1.087	1092	847
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	105.075	1094	114.500
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	96.821	1095	106.246
1.1 Series no subordinadas	0096	89.098	1096	97.814
1.2 Series subordinadas	0097	7.723	1097	8.432
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	4	1108	4
3.1 Derivados de cobertura	0109	4	1109	4
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: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
B) PASIVO CORRIENTE	0117	10.951	1117	11.404
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	10.935	1123	11.388
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	10.804	1124	11.258
1.1 Series no subordinadas	0125	10.790	1125	11.245
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	13	1128	13
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	7
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	7
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	123	1139	123
3.1 Derivados de cobertura	0140	123	1140	123
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	16	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	5	1157	6
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-264	1158	-237
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-264	1160	-237
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	116.849	1162	126.514

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	348	1201	461	2201	748	3201	952
1.1 Activos titulizados	0202	348	1202	461	2202	748	3202	952
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-44	1204	-45	2204	-86	3204	-91
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-18	1205	-20	2205	-36	3205	-41
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-11	1206	-10	2206	-20	3206	-19
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-15	1207	-15	2207	-30	3207	-31
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-16	1208	-91	2208	-54	3208	-200
A) MARGEN DE INTERESES	0209	288	1209	326	2209	607	3209	661
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	1	1216	0	2216	1	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-66	1217	-341	2217	-367	3217	-695
7.1 Servicios exteriores	0218	-20	1218	-10	2218	-22	3218	-23
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-20	1219	-10	2219	-22	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	-46	1224	-332	2224	-345	3224	-672
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-13	1225	-12	2225	-26	3225	-24
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	-7	3227	-7
7.3.4 Comisión variable	0228	-30	1228	-316	2228	-312	3228	-641
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	-223	1234	16	2234	-241	3234	34
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	-223	1236	16	2236	-241	3236	34
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: 30/06/2022

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	229	1300	-21	2300	241	3300	-30
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	275	1301	310	2301	586	3301	642
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	353	1302	466	2302	753	3302	960
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-17	1303	-20	2303	-35	3303	-43
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	-37	1305	-110	2305	-82	3305	-225
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	-9	1307	-10	2307	-19	3307	-20
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-15	1308	-15	2308	-31	3308	-31
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-46	1309	-332	2309	-345	3309	-672
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-13	1310	-12	2310	-25	3310	-24
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-4	1312	-4	2312	-8	3312	-8
2.4 Comisión variable	0313	-30	1313	-316	2313	-312	3313	-641
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	68	1322	308	2322	-1.027	3322	-380
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	88	1325	318	2325	-1.005	3325	-358
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	2.655	1326	2.983	2326	5.495	3326	5.905
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.897	1327	1.922	2327	3.264	3327	3.503
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	55	1328	45	2328	116	3328	103
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	-4.519	1331	-4.633	2331	-9.880	3331	-9.869
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-20	1332	-10	2332	-22	3332	-23
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	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-20	1336	-10	2336	-22	3336	-23
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	296	1337	287	2337	-786	3337	-411
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	12.900	1338	13.274	2338	13.983	3338	13.971
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	13.197	1339	13.560	2339	13.197	3339	13.560

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
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	-37	1357	-110	2357	-82	3357	-225
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-37	1358	-110	2358	-82	3358	-225
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	16	1360	91	2360	54	3360	200
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	21	1362	19	2362	28	3362	25
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: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2022								Situación cierre anual anterior 31/12/2021								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	0,67	0400	0,00	0420	0,00	0440	7,12	1380	0,66	1400	0,00	1420	0,00	1440	6,42	2380	0,00	2400	0,00	2420	0,00	2440	12,00
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	0,43	0401	0,00	0421	0,00	0441	5,20	1381	0,35	1401	0,00	1421	0,00	1441	6,67	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: 30/06/2022
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK, 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	53	0467	15	0474	2	0481	0	0488	17	0495	2.822	0502	0	0509	2.839
De 1 a 3 meses	0461	5	0468	5	0475	1	0482	0	0489	6	0496	291	0503	0	0510	297
De 3 a 6 meses	0462	3	0469	5	0476	0	0483	0	0490	6	0497	63	0504	0	0511	69
De 6 a 9 meses	0463	0	0470	0	0477	0	0484	0	0491	0	0498	0	0505	0	0512	0
De 9 a 12 meses	0464	1	0471	2	0478	0	0485	0	0492	2	0499	27	0506	0	0513	29
Más de 12 meses	0465	12	0472	59	0479	3	0486	13	0493	75	0500	489	0507	0	0514	563
Total	0466	74	0473	87	0480	7	0487	13	0494	107	0501	3.691	0508	0	1515	3.798

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	53	0522	15	0529	2	0536	0	0543	17	0550	2.822	0557	0	0564	2.839	0571	12.614	0578	12.614	0584	22,51
De 1 a 3 meses	0516	5	0523	5	0530	1	0537	0	0544	6	0551	291	0558	0	0565	297	0572	1.255	0579	1.255	0585	23,69
De 3 a 6 meses	0517	3	0524	5	0531	0	0538	0	0545	6	0552	63	0559	0	0566	69	0573	413	0580	413	0586	16,67
De 6 a 9 meses	0518	0	0525	0	0532	0	0539	0	0546	0	0553	0	0560	0	0567	0	0574	0	0581	0	0587	0,00
De 9 a 12 meses	0519	1	0526	2	0533	0	0540	0	0547	2	0554	27	0561	0	0568	29	0575	126	0582	126	0588	23,25
Más de 12 meses	0520	12	0527	59	0534	3	0541	13	0548	75	0555	489	0562	0	0569	563	0576	2.426	0583	2.426	0589	23,23
Total	0521	74	0528	87	0535	7	0542	13	0549	107	0556	3.691	0563	0	0570	3.798	0577	16.835			0590	22,56

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: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 25/09/2007	
Inferior a 1 año	0600	327	1600	328	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	989	1601	1.003	2601	29
Entre 2 y 3 años	0602	1.635	1602	1.548	2602	172
Entre 3 y 4 años	0603	2.744	1603	2.423	2603	1.182
Entre 4 y 5 años	0604	2.938	1604	3.516	2604	1.876
Entre 5 y 10 años	0605	24.342	1605	26.542	2605	31.419
Superior a 10 años	0606	70.478	1606	77.096	2606	715.322
Total	0607	103.452	1607	112.456	2607	750.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	11,16	1608	11,51	2608	22,77

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 25/09/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	17,57	1609	17,10	2609	3,04

Denominación Fondo: CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	2.021	0630	76.978	1620	2.091	1630	80.581	2620	2.898	2630	164.622
40% - 60%	0621	258	0631	25.202	1621	311	1631	29.916	2621	1.790	2631	189.164
60% - 80%	0622	8	0632	1.272	1622	12	1632	1.959	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	2.287	0638	103.452	1628	2.414	1638	112.456	2628	7.392	2638	750.000
Media ponderada (%)	0639	30,31	0649		1639	31,21	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: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 25/09/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,34	1650	1,44	2650	4,79
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,40	1651	4,40	2651	6,61
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	2,69

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: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	14	1660	1	1683	15	2660	1	2683	45
Aragón	0661	49	0684	1.794	1661	53	1684	1.955	2661	183	2684	15.913
Asturias	0662	0	0685	0	1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663	1	0686	82	1663	1	1686	86	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	5	1667	1	1690	6	2667	1	2690	28
Cataluña	0668	2.208	0691	100.455	1668	2.331	1691	109.230	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	160	1672	3	1695	168	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	0	1699	0	2676	1	2699	97
Comunidad Valenciana	0677	24	0700	942	1677	24	1700	996	2677	49	2700	3.875
País Vasco	0678	0	0701	0	1678	0	1701	0	2678	0	2701	0
Total España	0679	2.287	0702	103.452	1679	2.414	1702	112.456	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	2.287	0705	103.452	1682	2.414	1705	112.456	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: 30/06/2022
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK, BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Situación inicial 25/09/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	2,54			1710	2,43			2710	0,74		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

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: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2022			Situación cierre anual anterior 31/12/2021			Situación inicial 25/09/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	Nominal unitario (€) 0721	0722	1720	Nominal unitario (€) 1721	1722	2720	Nominal unitario (€) 2721	2722			
ES0347598007	SERIE A	7.263	13.753	99.888	7.263	15.016	109.060	7.263	100.000	726.300			
ES0347598015	SERIE B	72	32.587	2.346	72	35.580	2.562	72	100.000	7.200			
ES0347598023	SERIE C	165	32.587	5.377	165	35.580	5.871	165	100.000	16.500			
Total		0723	7.500	0724	107.611	1723	7.500	1724	117.492	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: 30/06/2022

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		0738	0739			
						0730	0731		0732	0733	0734	0735			0742	0736	0737
ES0347598007	SERIE A	NS	EURIBOR 3 m	0,30	0,00	0	0	SI	99.888	0	0	99.888					
ES0347598015	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,60	0,17	1	0	SI	2.346	0	0	2.347					
ES0347598023	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	1,75	1,32	12	0	SI	5.377	0	0	5.389					
Total						0740	13	0741	0	0743	107.611	0744	0	0745	107.625	0746	

	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 25/09/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,06	0748	0,06	0749	0,00

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: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2022								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2021							
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	4.195	626.412	0	79.522	4.301	608.122	0	79.522								
ES0347598015	SERIE B	99	4.854	0	1.221	101	4.424	0	1.220								
ES0347598023	SERIE C	226	11.123	17	5.056	232	10.139	20	4.983								
Total		0754	4.519	0755	642.389	0756	17	0757	85.800	1754	4.633	1755	622.685	1756	20	1757	85.725

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: 30/06/2022
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 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Situación inicial 25/09/2007
				0762	0763	0764
ES0347598007	SERIE A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0347598007	SERIE A	25/02/2022	SYP	AAA	AA+	AAA
ES0347598015	SERIE B	01/12/2020	MDY	Aa1	Aa1	Aa2
ES0347598015	SERIE B	25/02/2022	SYP	AA+	AA	AA
ES0347598023	SERIE C	27/07/2021	MDY	A2	A2	Baa2
ES0347598023	SERIE C	25/02/2022	SYP	AA	A+	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: 30/06/2022

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 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 25/09/2007	
Inferior a 1 año	0765	12.256	1765	13.332	2765	27.133
Entre 1 y 2 años	0766	10.795	1766	11.364	2766	23.166
Entre 2 y 3 años	0767	84.560	1767	10.893	2767	23.916
Entre 3 y 4 años	0768	0	1768	81.903	2768	24.864
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	0	2769	25.829
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	0	2770	140.239
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	484.853
Total	0772	107.611	1772	117.492	2772	750.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	2,83	1773	3,58	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: 30/06/2022

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		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	7,67	1777	7,02	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	

CAIXA PENEDES 2 TDA, FTA

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: 30/06/2022

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 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	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	-129	-129		
Total							0808 -129	0809 -129	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: 30/06/2022

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 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 25/09/2007		Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		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: 30/06/2022

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 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	68	7006	403	7009	0,07	7012	0,36	7015	0,10		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	68	7008	403	7011	0,07	7014	0,36	7017	0,10	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	587	7024	293	7027	0,57	7030	0,26	7033	0,51		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	587	7026	293	7029	0,57	7032	0,26	7035	0,51	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		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: 30/06/2022

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	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	13,79	14,43	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE C - ES0347598023	10,00	13,79	14,43	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE C - ES0347598023	1,00	0,07	0,10	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE B - ES0347598015	1,25	0,07	0,10	Nota de Valores 4.9.2.2
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0347598023	5,00	2,33	2,33	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE B - ES0347598015	7,42	2,33	2,33	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		7,67	7,36	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: 30/06/2022

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	11	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: 30/06/2022

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: 30/06/2022

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
		28/01/2022	28/04/2022											
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885													
Saldo inicial	0886	8.250	8.250											
Cobros del periodo	0887	5.734	4.649											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-18	-36											
Pagos por derivados	0889	-45	-37											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-8.250	-8.250											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-5.379	-4.536											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-9	-9											
Resto pagos/retenciones	0893	0	0											
Saldo disponible	0894	282	30											
Liquidación de comisión variable	0895	282	30											312

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: 30/06/2022

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