

TDA CAJAMAR 2, FTA

LIQUIDACION DEL PERIODO 27/06/16 - 26/09/16

	Euros
	Cajamar
I. Situación al 27/06/16:	10.057.041,11
Fondo de Reserva	7.500.000,00
Cantidad Dotada Línea Líquidez 27/06/16	2.557.041,11
II. Fondos recibidos del emisor	9.822.515,98
Principal:	8.015.542,09
Según calendario hasta 31/08/16:	5.991.348,02
Amort. Anticipada hasta 31/08/16:	2.024.194,07
Intereses:	1.806.973,89
III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):	19.879.557,09
IV. Total intereses de la reinversión:	-16.868,96
Intereses de la Cta. De Tesorería	-286,36
Intereses Cta De Reinversión	-14.011,44
Intereses Cta. Línea de Líquidez	-2.571,16
V. Recursos disponibles (III + IV):	19.862.688,13
VI. Varios:	25.419,11
VII. Liquidación SWAP:	-1.375.594,48
Cantidad a Pagar por la Parte A (JP Morgan):	-149.783,60
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	1.225.810,88
VIII. Pago a los Bonos:	7.373.358,55
Bonos A2:	
Intereses correspondientes al 26/09/16:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 26/09/16:	6.752.225,00
Bonos A3:	
Intereses correspondientes al 26/09/16:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 26/09/16:	0,00
Bonos B:	
Intereses correspondientes al 26/09/16:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 26/09/16:	286.934,70
Bonos C:	
Intereses correspondientes al 26/09/16:	1.765,00
Retenciones practicadas a los bonos:	-335,35
Amortización correspondiente al 26/09/16:	73.573,00
Bonos D:	
Intereses correspondientes al 26/09/16:	30.784,55
Retenciones practicadas a los bonos:	-5.849,06
Amortización correspondiente al 26/09/16:	228.076,30
Reinversión o devolución de las retenciones:	6.184,41
IX. Saldo disponible (V- VI + VII - VIII):	11.088.315,99
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo 27/06/16:	7.500.000,00
Aportación al Fondo de Reserva	0,00
Cantidad dotada de Línea de Líquidez 26/09/16	2.581.999,84
Margen de Intermediación Financiera	1.006.316,15
Fondo de Reserva 26/09/16:	7.500.000,00

Destinatario: CNMV; AIAF



Nº: 4492/16

Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Orense, 69
28020 Madrid
Tel.: 917020808
<http://www.tda-sgft.com>
TDA CAJAMAR 2liq.trim/Sep16

TD A CAJAMAR 2, FTA

Fondo de Titulización de Activos

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 26 de Septiembre de 2016

Importes en euros

I. BONOS A2 ES0377965019	Sobre 5750 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (23/05/05):	575.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	28.050.167,50 €	4.878,29 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	6.752.225,00 €	1.174,30 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	21.297.942,50 €	3.703,99 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	3,703990%	3,703990%

II. BONOS A3 ES0377965027	Sobre 2000 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (23/05/05):	200.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	200.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	200.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

III. BONOS B ES0377965035	Sobre 195 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (23/05/05):	19.500.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	9.690.973,50 €	49.697,30 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	286.934,70 €	1.471,46 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	9.404.038,80 €	48.225,84 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	48,225840%	48,225840%

IV. BONOS C ES0377965043	Sobre 50 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (23/05/05):	5.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	2.484.865,00 €	49.697,30 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	1.765,00 €	35,30 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	73.573,00 €	1.471,46 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	2.411.292,00 €	48.225,84 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	48,225840%	48,225840%

V. BONOS D ES0377965050	Sobre 155 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (23/05/05):	15.500.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	7.703.081,50 €	49.697,30 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	30.784,55 €	198,61 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	228.076,30 €	1.471,46 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	7.475.005,20 €	48.225,84 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	48,225840%	48,225840%

VI. EL FONDO	Importes en euros
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/08/16:	
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:	240.588.283,86 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:	9.228.395,29 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:	240.765.847,07 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:	10.296.632,05 €
2. Amortización del período 31/05/16 a 31/08/16:	8.015.542,09 €
a) Según calendario:	5.991.348,02 €
b) Amortización anticipada hasta 31/08/16:	2.024.194,07 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):	
a) Último año:	2,80%
b) Último semestre:	2,64%
c) Último trimestre:	3,23%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:	1,00%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:	0,09%
6. Porcentaje de fallidos (1):	4,10%
7. Nivel de Impago (2)	0,18%

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

(2) Importe de principal de las Participaciones Hipotecarias impagadas durante el período de tiempo comprendido entre el segundo y el noveno mes inmediatamente anteriores a la correspondiente Fecha de Pago respecto al saldo nominal pendiente de las Participaciones Hipotecarias

Destinatarios: Emisor; CNMV; AIAF.



Nº: 4493/16

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.
Orense, 69

28020 Madrid

Tel.: 917020808

http://www.tda-sgft.com

TD A CAJAMAR 2\Infoinver.trim.\Sep16

TDA CAJAMAR 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 27/06/16 - 26/09/16

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	18 de mayo de 2005
Fecha Emisión BTH	18 de mayo de 2005
Fecha Final Amortización BTH (2,80% TAA)	26 de septiembre de 2024
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca	Cajamar
Agente de Pagos	BNP PARIBAS
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Fitch Ibcá / Standard & Poor's
Calificación	Bono A2: (F) AA+ (sf) / (S&P) AA+ (sf) Bono A3: (F) AA+ (sf) / (S&P) A (sf) Bono B: (F) A (sf) / (S&P) A (sf) Bono C: (F) A- (sf) / (S&P) A- (sf) Bono D: (F) BB+ (sf) / (S&P) BBB- (sf)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Nombre	Bonos de Titulización TDA CAJAMAR 2
Serie A2:	
Código ISIN	ES0377965019
Nominal en circulación total (inicial)	575.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	21.297.942,50 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	3.703,99 Euros

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Nombre	Bonos de Titulización TDA CAJAMAR 2
Serie A3:	
Código ISIN	ES0377965027
Nominal en circulación total (inicial)	200.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	200.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0377965035
Nominal en circulación total (inicial)	19.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	9.404.038,80 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	48.225,84 Euros
Serie C:	
Código ISIN	ES0377965043
Nominal en circulación total (inicial)	5.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	2.411.292,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	48.225,84 Euros
Serie D:	
Código ISIN	ES0377965050
Nominal en circulación total (inicial)	15.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	7.475.005,20 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	48.225,84 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA

* Liquidación del Período: 27/06/16 - 26/09/16
* Flujos de Caja del Período: 27/06/16 - 26/09/16
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 26 de Septiembre de 2016

TDA CAJAMAR 2, FTA
Fondo de Titulización de Activos
FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 27/06/16 - 26/09/16

Euros

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip. Amortización Participaciones Hip.	8.015.542,09	7.340.809,00
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH Intereses recibidos de las PHs Intereses Inversiones Temporales	1.806.973,89 -16.868,96	32.549,55
III. GASTOS		
Comisiones Periódicas: Neto SWAP Remuneración Variable Préstamo Participativo		25.419,11 1.375.594,48 1.006.316,15
Total Ingresos/Pagos	9.805.647,02	9.780.688,29
Saldo inicial 27/06/16 A Inversiones Temporales	10.057.041,11	10.081.999,84
Total	19.862.688,13	19.862.688,13
Retenciones practicadas el 26/09/16 A Inversiones Temporales	6.184,41	6.184,41

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 4499/16

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA CAJAMAR 2(fluj.trim)Sep16