

TDA CAJAMAR 2, FTA
LIQUIDACION DEL PERIODO 28/06/21 - 27/09/21

| | Euros |
|---|----------------------|
| | Cajamar |
| I. Situación al 28/06/21: | 10.476.270,57 |
| Fondo de Reserva | 7.500.000,00 |
| Cantidad Dotada Línea Líquidez 28/06/21 | 2.976.270,57 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 6.027.498,41 |
| Principal: | 5.193.989,89 |
| Según calendario hasta 31/08/21: | 4.085.332,41 |
| Amort. Anticipada hasta 31/08/21: | 1.108.657,48 |
| Intereses: | 833.508,52 |
| III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II): | 16.503.768,98 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | -21.310,53 |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | -393,95 |
| Intereses Cta De Reinversión | -16.637,72 |
| Intereses Cta. Línea de Liquidez | -4.278,86 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 16.482.458,45 |
| VI. Varios: | 17.294,62 |
| VII. Liquidación SWAP: | -769.965,68 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (JP Morgan) : | -160.034,02 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo): | 609.931,66 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 4.810.339,75 |
| Bonos A3: | |
| Intereses correspondientes al 27/09/21: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 27/09/21: | 4.412.800,00 |
| Bonos B: | |
| Intereses correspondientes al 27/09/21: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 27/09/21: | 187.521,75 |
| Bonos C: | |
| Intereses correspondientes al 27/09/21: | 38,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -7,22 |
| Amortización correspondiente al 27/09/21: | 48.082,50 |
| Bonos D: | |
| Intereses correspondientes al 27/09/21: | 12.841,75 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -2.439,93 |
| Amortización correspondiente al 27/09/21: | 149.055,75 |
| Reinversión o devolución de las retenciones: | 2.447,15 |
| IX. Saldo disponible (V- VI + VII - VIII): | 10.884.858,40 |
| Distribución del saldo disponible: | |
| Fondo de Reserva previo 28/06/21: | 7.500.000,00 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 0,00 |
| Cantidad dotada de Línea de Liquidez 27/09/21 | 2.992.581,98 |
| Margen de Intermediación Financiera | 392.276,42 |
| Fondo de Reserva 27/09/21: | 7.500.000,00 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 3515/21

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.:917020808
<http://www.tda-sgft.com>
TDA CAJAMAR 2\liq.trim\Sep21

TDA CAJAMAR 2, FTA

Fondo de Titulización de Activos

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 27 de Septiembre de 2021

Importes en euros

| I. 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: | 114.633.780,00 € | 57.316,89 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 4.412.800,00 € | 2.206,40 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 110.220.980,00 € | 55.110,49 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 55,110490% | 55,110490% |

| II. 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: | 4.871.353,50 € | 24.981,30 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 187.521,75 € | 961,65 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 4.683.831,75 € | 24.019,65 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 24,019650% | 24,019650% |

| III. 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: | 1.249.065,00 € | 24.981,30 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 38,00 € | 0,76 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 48.082,50 € | 961,65 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 1.200.982,50 € | 24.019,65 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 24,019650% | 24,019650% |

| IV. 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: | 3.872.101,50 € | 24.981,30 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 12.841,75 € | 82,85 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 149.055,75 € | 961,65 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 3.723.045,75 € | 24.019,65 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 24,019650% | 24,019650% |

V. EL FONDO Importes en euros

| | |
|---|-----------------------|
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/08/21: | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas: | 119.828.832,53 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas: | 3.580.487,84 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas: | 119.918.145,49 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidas: | 4.248.361,43 € |
| 2. Amortización del período 31/05/21 a 31/08/21: | 5.193.989,89 € |
| a) Según calendario: | 4.085.332,41 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/08/21: | 1.108.657,48 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | |
| a) Ultimo año: | 3,65% |
| b) Ultimo semestre: | 3,79% |
| c) Ultimo trimestre: | 3,51% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | 0,75% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses: | 0,03% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | 3,42% |
| 7. Nivel de Impago (2) | 0,13% |

(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: 3516/21

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

TDA CAJAMAR 2\Infoinver.trim.\Sep21

TDA CAJAMAR 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 28/06/21 - 27/09/21
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 (3,65% TAA) | 26 de marzo 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 Ibcra / Standard & Poor's |
| Calificación | Bono A3: (F) AAA (sf) / (S&P) AA (sf) Bono B: (F) AAA (sf) / (S&P) AA- (sf) Bono C: (F) AAA (sf) / (S&P) A+ (sf) Bono D: (F) A+ (sf) / (S&P) BBB+ (sf) |

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) | 110.220.980,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 55.110,49 Euros |

TDACAJAMAR2\INFO.trim\Sep21

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Nombre | Bonos de Titulización TDA CAJAMAR 2 |
|---|-------------------------------------|
| Serie B: | |
| Código ISIN | ES0377965035 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 19.500.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 4.683.831,75 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 24.019,65 Euros |
| Serie C: | |
| Código ISIN | ES0377965043 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 5.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 1.200.982,50 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 24.019,65 Euros |
| Serie D: | |
| Código ISIN | ES0377965050 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 15.500.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 3.723.045,75 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 24.019,65 Euros |

III. INFORMACION INCLUIDA

| |
|---|
| * Liquidación del Período: 28/06/21 - 27/09/21 |
| * Flujos de Caja del Período: 28/06/21 - 27/09/21 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 27 de Septiembre de 2021 |

TDACAJAMAR2\INFO.trim\Sep21

TDA CAJAMAR 2, FTA
Fondo de Titulización de Activos
FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 28/06/21 - 27/09/21

Euros

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
|---|----------------------|----------------------|
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 4.797.460,00 |
| Amortización Participaciones Hip. | 5.193.989,89 | |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 12.879,75 |
| Intereses recibidos de las PHs | 833.508,52 | |
| Intereses Inversiones Temporales | -21.310,53 | |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: | | 17.294,62 |
| Neto SWAP | | 769.965,68 |
| Margen de Intermediación Financiera | | 392.276,42 |
| Total Ingresos/Pagos | 6.006.187,88 | 5.989.876,47 |
| Saldo inicial 28/06/21 A Inversiones Temporales | 10.476.270,57 | 10.492.581,98 |
| Total | 16.482.458,45 | 16.482.458,45 |
| Retenciones practicadas el 27/09/21 A Inversiones Temporales | 2.447,15 | 2.447,15 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 3522/21

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA CAJAMAR 2\fluj.trim\Sep21