

TDA IBERCAJA 2 - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 26/10/21 - 26/01/22

| | Euros |
|--|----------------------|
| I. Situación al 26/10/21: | 4.500.000,42 |
| Saldo inicial Cta. Reversión | 4.500.000,42 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 6.096.084,08 |
| Principal: | |
| Según calendario hasta 31/12/21: | 4.545.930,03 |
| Amort. Anticipada hasta 31/12/21: | 1.446.353,45 |
| Intereses: | 103.800,60 |
| III. Recursos disponibles (I + II): | 10.596.084,50 |
| IV. Total intereses de la reversión: | -10.290,57 |
| Intereses Cta. Reversión | -10.210,31 |
| Intereses Cta. Tesorería | -80,26 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 10.585.793,93 |
| VI. Varios: | 29.010,30 |
| VII. Liquidación SWAP: | -48.495,33 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (Fondo): | 103.800,60 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Credit Suisse): | 55.305,27 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 6.008.287,90 |
| Bonos A: | |
| Intereses correspondientes al 26/01/22: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 26/01/22: | 5.257.482,30 |
| Bonos B: | |
| Intereses correspondientes al 26/01/22: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 26/01/22: | 250.043,08 |
| Bonos C: | |
| Intereses correspondientes al 26/01/22: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 26/01/22: | 81.620,28 |
| Bonos D: | |
| Intereses correspondientes al 26/01/22: | 2.696,98 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -512,43 |
| Amortización correspondiente al 26/01/22: | 53.117,96 |
| Bonos E: | |
| Intereses correspondientes al 26/01/22: | 21.096,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -4.008,24 |
| Amortización correspondiente al 26/01/22: | 342.231,30 |
| Reversión o devolución de las retenciones: | 4.520,67 |
| IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII): | 4.500.000,40 |
| Distribución del saldo disponible: | |
| Fondo de Reserva 26/10/21: | 4.500.000,00 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 0,00 |
| Otros Recursos para el siguiente pago | 0,40 |
| Margen de intermediación financiera | 0,00 |
| Fondo de Reserva 26/01/22: | 4.500.000,00 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 254/22

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDAIBERCAJA2\liq.trim\Ene22

TDA IBERCAJA 2

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 26 de Enero de 2022

Importes en euros

| I. BONOS A ES0338451000 | Sobre 8703 bonos | Por Bono |
|---|-------------------------|-----------------|
| 1. Saldo inicial (18/10/05): | 870.300.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 109.833.687,63 € | 12.620,21 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 5.257.482,30 € | 604,10 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 104.576.205,33 € | 12.016,11 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 12,016110% | 12,016110% |

| II. BONOS B ES0338451018 | Sobre 193 bonos | Por Bono |
|---|------------------------|-----------------|
| 1. Saldo inicial (18/10/05): | 19.300.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 5.223.624,13 € | 27.065,41 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 250.043,08 € | 1.295,56 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 4.973.581,05 € | 25.769,85 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 25,769850% | 25,769850% |

| III. BONOS C ES0338451026 | Sobre 63 bonos | Por Bono |
|---|-----------------------|-----------------|
| 1. Saldo inicial (18/10/05): | 6.300.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 1.705.120,83 € | 27.065,41 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 81.620,28 € | 1.295,56 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 1.623.500,55 € | 25.769,85 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 25,769850% | 25,769850% |

| IV. BONOS D ES0338451034 | Sobre 41 bonos | Por Bono |
|---|-----------------------|-----------------|
| 1. Saldo inicial (18/10/05): | 4.100.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 1.109.681,81 € | 27.065,41 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 2.696,98 € | 65,78 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 53.117,96 € | 1.295,56 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 1.056.563,85 € | 25.769,85 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 25,769850% | 25,769850% |

| V. BONOS E ES0338451042 | Sobre 45 bonos | Por Bono |
|---|-----------------------|-----------------|
| 1. Saldo inicial (18/10/05): | 4.500.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 2.797.327,35 € | 62.162,83 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 21.096,00 € | 468,80 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 342.231,30 € | 7.605,14 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 2.455.096,05 € | 54.557,69 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 54,557690% | 54,557690% |

| VI. EL FONDO | Importes en euros |
|--|--------------------------|
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/12/21: | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas: | 112.229.829,41 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas: | 1.238.196,79 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas: | 112.333.910,83 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidas: | 1.661.921,22 € |
| 2. Amortización del período 30/09/21 a 31/12/21: | 5.992.283,48 € |
| a) Según calendario: | 4.545.930,03 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/12/21: | 1.446.353,45 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | |
| a) Último año: | 4,21% |
| b) Último semestre: | 4,26% |
| c) Último trimestre: | 4,82% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | 0,38% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 17 meses: | 0,07% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | 1,46% |
| 7. Nivel de Impago (2): | 0,26% |

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 18 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: Cedente; CNMV; AIAF.



Nº: 255/22

Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Orense, 58
28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

TDAIBERCAJA2\Info\inver.trim\Ene22

TDA IBERCAJA 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 26/10/21 - 26/01/22

| I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO | |
|---|--|
| Fecha de Constitución del Fondo | 13 de octubre de 2005 |
| Fecha Emisión BTH | 13 de octubre de 2005 |
| Fecha Final Amortización Bonos (teórica) (4,21% TAA) | 26 de julio de 2023 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT, S.A. |
| Emisor Participaciones Hipotecarias | Ibercaja Banco |
| Agente de Pagos | Société Générale, Sucursal en España |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Moody's Investors Service España S.A Standard & Poor's |
| Calificación | Bono A: (M) Aa1 (sf) / (S&P) AAA (sf) Bono B: (M) A3 (sf) / (S&P) AA+ (sf) Bono C: (M) Baa3 (sf) / (S&P) AA (sf) Bono D: (M) Ba1(sf) / (S&P) A+ (sf) Bono E: (M) Ca (sf) / (S&P) - |
| II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO | |
| Nombre | Bonos de Titulización TDA IBERCAJA 2 |
| Serie A: | |
| Código ISIN | ES0338451000 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 870.300.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 104.576.205,33 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 12.016,11 Euros |
| Serie B: | |
| Código ISIN | ES0338451018 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 19.300.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 4.973.581,05 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 25.769,85 Euros |

TDA IBERCAJA 2\INFO.trim\Ene22

| II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.) | |
|--|---|
| Nombre | Bonos de Titulización TDA IBERCAJA 2 |
| Serie C: | |
| Código ISIN | ES0338451026 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 6.300.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 1.623.500,55 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 25.769,85 Euros |
| Serie D: | |
| Código ISIN | ES0338451034 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 4.100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 1.056.563,85 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 25.769,85 Euros |
| Serie E: | |
| Código ISIN | ES0338451042 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 4.500.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 2.455.096,05 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 54.557,69 Euros |

| III. INFORMACION INCLUIDA |
|--|
| * Liquidación del Período: 26/10/21 - 26/01/22 |
| * Flujos de Caja del Período: 26/10/21 - 26/01/22 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 26 de Enero de 2022 |

TDA IBERCAJA 2**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 26/10/21 - 26/01/22:**

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | Euros | |
|--|----------------------|----------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 5.984.494,92 |
| Amortización Participaciones Hip. | 5.992.283,48 | |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 23.792,98 |
| Intereses recibidos de las PHs | 103.800,60 | |
| Intereses Inversiones Temporales | -10.290,57 | |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: | | 29.010,30 |
| Neto SWAP | | 48.495,33 |
| Margen de intermediación financiera | | 0,00 |
| Total Ingresos/Pagos | 6.085.793,51 | 6.085.793,53 |
| Saldo inicial 26/10/21 | 4.500.000,42 | |
| A Inversiones Temporales | | 4.500.000,40 |
| Total | 10.585.793,93 | 10.585.793,93 |
| Retenciones practicadas: A inversiones temporales | 4.520,67 | 4.520,67 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 261/22**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDAIBERCAJA2\fluj.trim\Ene22