

**CAIXA PENEDES TDA 2 - Fondo de Titulización de Activos**

**LIQUIDACION DEL PERIODO 28/10/20 - 28/01/21**

	<b>Euros</b>
<b>I. Situación al 28/10/20:</b>	<b>8.250.000,00</b>
Fondo de Reserva	8.250.000,00
<b>II. Fondos recibidos del emisor</b>	<b>5.751.375,69</b>
<b>Principal:</b>	
Según calendario hasta 31/12/20:	3.110.983,94
Amort. Anticipada hasta 31/12/20:	2.065.397,40
<b>Intereses:</b>	<b>574.994,35</b>
<b>III. Subtotal Recursos disponibles ( I + II):</b>	<b>14.001.375,69</b>
<b>IV. Total intereses de la reinversión:</b>	<b>-15.890,51</b>
Intereses de la Cta. De Cobros	-2.432,43
Intereses de la Cta. De Tesorería	-13.458,08
<b>V. Recursos disponibles ( III+IV ):</b>	<b>13.985.485,18</b>
<b>VI. Gastos:</b>	<b>26.691,50</b>
<b>VII. Liquidación SWAP:</b>	<b>-114.682,95</b>
Cantidad a Pagar por la Parte A (JP Morgan Chase):	-202.286,41
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	-87.603,46
<b>VIII. Pago a los Bonos:</b>	<b>5.258.710,29</b>
<b>Bonos A:</b>	
Intereses correspondientes al 28/01/21:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 28/01/21:	4.860.472,23
<b>Bonos B:</b>	
Intereses correspondientes al 28/01/21:	695,52
Retenciones practicadas a los bonos:	-132,15
Amortización correspondiente al 28/01/21:	114.168,24
<b>Bonos C:</b>	
Intereses correspondientes al 28/01/21:	21.738,75
Retenciones practicadas a los bonos:	-4.130,36
Amortización correspondiente al 28/01/21:	261.635,55
<b>Reinversión o devolución de las retenciones:</b>	<b>4.262,51</b>
<b>IX. Saldo disponible ( V - VI + VII - VIII ):</b>	<b>8.585.400,44</b>
<b>Distribución del saldo disponible:</b>	
Fondo de Reserva previo (28/10/20):	8.250.000,00
Aportación al Fondo de Reserva	0,00
Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada	10.351,92
Amortización Préstamo Participativo	0,00
<b>Remuneración Variable Prést. Participativo</b>	<b>325.048,52</b>
Fondo de Reserva 28/01/21:	8.250.000,00

Destinatarios: CNMV, AIAF



**Nº: 293/21**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

CAIXA PENEDES 2 TDA\liq.trim\Ene21

**CAIXA PENEDES TDA 2****Fondo de Titulización de Activos****INFORMACION A LOS INVERSORES****FECHA DE PAGO: 28 de Enero de 2021**

Importes en euros

<b>I. BONOS A ES0347598007</b>	<b>Sobre 7263 bonos</b>	<b>Por Bono</b>
1. Saldo inicial (01/10/2007):	726.300.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	127.338.983,28 €	17.532,56 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	4.860.472,23 €	669,21 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	122.478.511,05 €	16.863,35 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	16,863350%	16,863350%

<b>II. BONOS B ES0347598015</b>	<b>Sobre 72 bonos</b>	<b>Por Bono</b>
1. Saldo inicial (01/10/2007):	7.200.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	2.991.095,28 €	41.542,99 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	695,52 €	9,66 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	114.168,24 €	1.585,67 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	2.876.927,04 €	39.957,32 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	39,957320%	39,957320%

<b>III. BONOS C ES0347598023</b>	<b>Sobre 165 bonos</b>	<b>Por Bono</b>
1. Saldo inicial (01/10/2007):	16.500.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	6.854.593,35 €	41.542,99 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	21.738,75 €	131,75 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	261.635,55 €	1.585,67 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	6.592.957,80 €	39.957,32 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	39,957320%	39,957320%

<b>IV. EL FONDO</b>	<b>Importes en euros</b>	
<b>1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/12/20:</b>		
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:		131.948.412,54 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:		246.768,70 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:		131.971.002,16 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:		288.104,24 €
<b>2. Amortización del período 30/09/20 a 31/12/20:</b>		<b>5.176.381,34 €</b>
a) Según calendario:		3.110.983,94 €
b) Amortización anticipada hasta 31/12/20:		2.065.397,40 €
<b>3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):</b>		
a) Último año:		4,54%
b) Último semestre:		5,50%
c) Último trimestre:		5,89%
<b>4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:</b>		<b>0,13%</b>
<b>5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:</b>		<b>0,09%</b>
<b>6. Porcentaje de fallidos (1):</b>		<b>0,22%</b>
<b>7. Nivel de Impago (2)</b>		<b>0,09%</b>

(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 con morosidad superior a 90 días en la Fecha de Cobro inmediata anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF



**Nº: 294/21**

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.  
Orense, 58  
28020 Madrid  
Tel.: 917020808

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

CAIXA PENEDES 2 TDA\Info\inver.trim\Ene21

**CAIXA PENEDES TDA 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
**INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 28/10/20-28/01/21**
**I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO**

Fecha de Constitución del Fondo	26 de septiembre de 2007
Fecha Emisión Bonos	26 de septiembre de 2007
Fecha Final Amortización Bonos (4,54% TAA)	28 de octubre de 2024
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias y CTH	Bankia (Caixa Penedés); Banco de Sabadell (Caixa Penedés)
Agente de Pagos	Société Générale, Sucursal en España
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Moody's Investors Service/ S&P
Calificación	Bonos A: (S&P) A- (sf) / (M) Aa1(sf) Bonos B: (S&P) A- (sf) / (M) A3(sf) Bonos C: (S&P) BBB (sf) / (M) Ba1(sf)

**II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO**

Nombre	Bonos de Titulización CAIXA PENEDES TDA 2
Serie A:	
Código ISIN	ES0347598007
Nominal en circulación total (inicial)	726.300.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	122.478.511,05 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	16.863,35 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0347598015
Nominal en circulación total (inicial)	7.200.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	2.876.927,04 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	39.957,32 Euros
Serie C:	
Código ISIN	ES0347598023
Nominal en circulación total (inicial)	16.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	6.592.957,80 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	39.957,32 Euros

**III. INFORMACION INCLUIDA**

* Liquidación del Período:28/10/20-28/01/21
* Flujos de Caja del Período:28/10/20-28/01/21
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 28 de Enero de 2021

**CAIXA PENEDES TDA 2***Fondo de Titulización de Activos***FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 28/10/20 - 28/01/21**

	Euros	
	Ingresos	Pagos
<b>I. INVERSIONES/FINANCIACIONES</b>		
Amortización Bonos Titulización Hip.		5.236.276,02
Amortización Participaciones Hip.	5.176.381,34	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
<b>II. INTERESES</b>		
Intereses pagados a los BTH		22.434,27
Intereses recibidos de las PHs	574.994,35	
Intereses Ptmos. Subordinados		10.351,92
Intereses Inversiones Temporales	-15.890,51	
<b>III. GASTOS</b>		
Comisiones Periódicas:		26.691,50
Neto SWAP		114.682,95
Remuneración Variable Préstamo Participativo		325.048,52
<b>Total Ingresos/Pagos</b>	<b>5.735.485,18</b>	<b>5.735.485,18</b>
Saldo inicial 28/10/20	8.250.000,00	
A Inversiones Temporales		8.250.000,00
<b>Total</b>	<b>13.985.485,18</b>	<b>13.985.485,18</b>
Retenciones practicadas el 28/01/21	4.262,51	
A Inversiones Temporales		4.262,51

**Nº: 300/21**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

CAIXA PENEDES 2 TDA\fluj.trim\Ene21