

**CAIXA PENEDES TDA 2 - Fondo de Titulización de Activos**
**LIQUIDACION DEL PERIODO 28/01/20 - 28/04/20**

|  | Euros                |
|--|----------------------|
| <b>I. Situación al 28/01/20:</b>                     | <b>8.250.000,00</b>  |
| Fondo de Reserva                                     | 8.250.000,00         |
| <b>II. Fondos recibidos del emisor</b>               | <b>7.997.494,89</b>  |
| <b>Principal:</b>                                    |                      |
| Según calendario hasta 31/03/20:                     | 5.609.143,08         |
| Amort. Anticipada hasta 31/03/20:                    | 1.718.593,74         |
| <b>Intereses:</b>                                    | <b>669.758,07</b>    |
| <b>III. Subtotal Recursos disponibles ( I + II):</b> | <b>16.247.494,89</b> |
| <b>IV. Total intereses de la reinversión:</b>        | <b>-18.351,49</b>    |
| Intereses de la Cta. De Cobros                       | -3.438,04            |
| Intereses de la Cta. De Tesorería                    | -14.913,45           |
| <b>V. Recursos disponibles ( III+IV ):</b>           | <b>16.229.143,40</b> |
| <b>VI. Gastos:</b>                                   | <b>17.711,71</b>     |
| <b>VII. Liquidación SWAP:</b>                        | <b>-98.475,02</b>    |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (JP Morgan Chase):   | -174.401,20          |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):             | -75.926,18           |
| <b>VIII. Pago a los Bonos:</b>                       | <b>5.174.894,34</b>  |
| <b>Bonos A:</b>                                      |                      |
| Intereses correspondientes al 28/04/20:              | 0,00                 |
| Retenciones practicadas a los bonos:                 | 0,00                 |
| Amortización correspondiente al 28/04/20:            | 4.777.528,77         |
| <b>Bonos B:</b>                                      |                      |
| Intereses correspondientes al 28/04/20:              | 1.792,08             |
| Retenciones practicadas a los bonos:                 | -340,50              |
| Amortización correspondiente al 28/04/20:            | 112.220,64           |
| <b>Bonos C:</b>                                      |                      |
| Intereses correspondientes al 28/04/20:              | 26.180,55            |
| Retenciones practicadas a los bonos:                 | -4.974,30            |
| Amortización correspondiente al 28/04/20:            | 257.172,30           |
| <b>Reinversión o devolución de las retenciones:</b>  | <b>5.314,80</b>      |
| <b>IX. Saldo disponible ( V - VI + VII - VIII ):</b> | <b>10.938.062,33</b> |
| <b>Distribución del saldo disponible:</b>            |                      |
| Fondo de Reserva previo (28/01/20):                  | 8.250.000,00         |
| Aportación al Fondo de Reserva                       | 0,00                 |
| Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada      | 12.804,46            |
| Amortización Préstamo Participativo                  | 0,00                 |
| <b>Remuneración Variable Prést. Participativo</b>    | <b>2.675.257,87</b>  |
| Fondo de Reserva 28/04/20:                           | 8.250.000,00         |

Destinatarios: CNMV, AIAF


**Nº: 1503/20**

Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

CAIXA PENEDES 2 TDAliq.trimAbr20

**CAIXA PENEDES TDA 2****Fondo de Titulización de Activos****INFORMACION A LOS INVERSORES****FECHA DE PAGO: 28 de Abril de 2020**

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: | 141.062.131,26 €        | 19.422,02 €     |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:  | 0,00 €                  | 0,00 €          |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:   | 4.777.528,77 €          | 657,79 €        |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:      | 136.284.602,49 €        | 18.764,23 €     |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento:                   | 18,764230%              | 18,764230%      |

| <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: | 3.313.442,88 €        | 46.020,04 €     |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:  | 1.792,08 €            | 24,89 €         |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:   | 112.220,64 €          | 1.558,62 €      |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:      | 3.201.222,24 €        | 44.461,42 €     |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento:                   | 44,461420%            | 44,461420%      |

| <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: | 7.593.306,60 €         | 46.020,04 €     |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:  | 26.180,55 €            | 158,67 €        |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:   | 257.172,30 €           | 1.558,62 €      |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:      | 7.336.134,30 €         | 44.461,42 €     |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento:                   | 44,461420%             | 44,461420%      |

| <b>IV. EL FONDO</b>   | <b>Importes en euros</b> |                       |
|---|--------------------------|-----------------------|
| <b>1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/03/20:</b> |                          |                       |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:              |                          | 146.821.967,07 €      |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:                 |                          | 105.269,38 €          |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:                    |                          | 146.873.379,25 €      |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:                       |                          | 126.338,21 €          |
| <b>2. Amortización del período 31/12/19 a 31/03/20:</b>     |                          | <b>7.327.736,82 €</b> |
| a) Según calendario:  |                          | 5.609.143,08 €        |
| b) Amortización anticipada hasta 31/03/20:                  |                          | 1.718.593,74 €        |
| <b>3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):</b>     |                          |                       |
| a) Último año:  |                          | 4,68%                 |
| b) Último semestre:   |                          | 4,87%                 |
| c) Último trimestre:  |                          | 4,45%                 |
| <b>4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:</b>           |                          | <b>0,18%</b>          |
| <b>5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:</b>          |                          | <b>0,20%</b>          |
| <b>6. Porcentaje de fallidos (1):</b>                       |                          | <b>0,09%</b>          |
| <b>7. Nivel de Impago (2)</b>                               |                          | <b>0,27%</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: 1504/20**

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

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

CAIXA PENEDES 2 TDA\Infoinver.trim\Abr20

**CAIXA PENEDES TDA 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
**INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 28/01/20-28/04/20**
**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 (4,68% TAA)  | 30 de octubre de 2023  |
| Sociedad Gestora                            | Titulización de Activos, SGFT,S.A.   |
| Emisores Participaciones Hipotecarias y CTH | Bankia (Caixa Penedés);<br>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)<br>Bonos B: (S&P) A- (sf) / (M) A3(sf)<br>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)     | 136.284.602,49 Euros                      |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros                          |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 18.764,23 Euros                           |
| Serie B:                                  |   |
| Código ISIN                               | ES0347598015                              |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 7.200.000,00 Euros                        |
| Nominal en circulación total (actual)     | 3.201.222,24 Euros                        |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros                          |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 44.461,42 Euros                           |
| Serie C:                                  |   |
| Código ISIN                               | ES0347598023                              |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 16.500.000,00 Euros                       |
| Nominal en circulación total (actual)     | 7.336.134,30 Euros                        |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros                          |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 44.461,42 Euros                           |

**III. INFORMACION INCLUIDA**

|  |
|--|
| * Liquidación del Período:28/01/20-28/04/20                        |
| * Flujos de Caja del Período:28/01/20-28/04/20                     |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 28 de Abril de 2020 |

**CAIXA PENEDES TDA 2***Fondo de Titulización de Activos***FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 28/01/20 - 28/04/20**

| <b>I. INVERSIONES/FINANCIACIONES</b>         | <b>Euros</b>         |                      |
|--|----------------------|----------------------|
|  | <u>Ingresos</u>      | <u>Pagos</u>         |
| Amortización Bonos Titulización Hip.         |                      | 5.146.921,71         |
| Amortización Participaciones Hip.            | 7.327.736,82         |                      |
| Amortización Ptmos. Subordinados             |                      | 0,00                 |
| <b>II. INTERESES</b>                         |                      |                      |
| Intereses pagados a los BTH                  |                      | 27.972,63            |
| Intereses recibidos de las PHs               | 669.758,07           |                      |
| Intereses Ptmos. Subordinados                |                      | 12.804,46            |
| Intereses Inversiones Temporales             | -18.351,49           |                      |
| <b>III. GASTOS</b>                           |                      |                      |
| Comisiones Periódicas:                       |                      | 17.711,71            |
| Neto SWAP                                    |                      | 98.475,02            |
| Remuneración Variable Préstamo Participativo |                      | 2.675.257,87         |
| <b>Total Ingresos/Pagos</b>                  | <b>7.979.143,40</b>  | <b>7.979.143,40</b>  |
| Saldo inicial 28/01/20                       | 8.250.000,00         |                      |
| A Inversiones Temporales                     |                      | 8.250.000,00         |
| <b>Total</b>                                 | <b>16.229.143,40</b> | <b>16.229.143,40</b> |
| Retenciones practicadas el 28/04/20          | 5.314,80             |                      |
| A Inversiones Temporales                     |                      | 5.314,80             |

**Nº: 1510/20**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

CAIXA PENEDES 2 TDA\fluj.trim\Abr20