

CAIXA PENEDES TDA 2 - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 28/04/20 - 28/07/20

	Euros
I. Situación al 28/04/20:	8.250.000,00
Fondo de Reserva	8.250.000,00
II. Fondos recibidos del emisor	5.066.910,32
Principal:	
Según calendario hasta 30/06/20:	3.293.388,35
Amort. Anticipada hasta 30/06/20:	1.209.056,92
Intereses:	564.465,05
III. Subtotal Recursos disponibles (I + II):	13.316.910,32
IV. Total intereses de la reinversión:	-16.332,48
Intereses de la Cta. De Cobros	-2.258,61
Intereses de la Cta. De Tesorería	-14.073,87
V. Recursos disponibles (III+IV):	13.300.577,84
VI. Gastos:	22.632,50
VII. Liquidación SWAP:	-9.864,55
Cantidad a Pagar por la Parte A (JP Morgan Chase):	-96.494,66
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	-86.630,11
VIII. Pago a los Bonos:	4.562.091,84
Bonos A:	
Intereses correspondientes al 28/07/20:	37.186,56
Retenciones practicadas a los bonos:	-7.065,45
Amortización correspondiente al 28/07/20:	4.170.269,34
Bonos B:	
Intereses correspondientes al 28/07/20:	3.301,20
Retenciones practicadas a los bonos:	-627,23
Amortización correspondiente al 28/07/20:	97.957,44
Bonos C:	
Intereses correspondientes al 28/07/20:	28.891,50
Retenciones practicadas a los bonos:	-5.489,39
Amortización correspondiente al 28/07/20:	224.485,80
Reinversión o devolución de las retenciones:	13.182,07
IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII):	8.705.988,95
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo (28/04/20):	8.250.000,00
Aportación al Fondo de Reserva	0,00
Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada	16.850,17
Amortización Préstamo Participativo	0,00
Remuneración Variable Prést. Participativo	439.138,78
Fondo de Reserva 28/07/20:	8.250.000,00

Destinatarios: CNMV, AIAF



Nº: 2732/20

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

CAIXA PENEDES 2 TDAliq.trimJul20

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

Importes en euros

I. BONOS A ES0347598007	Sobre 7263 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (01/10/2007):	726.300.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	136.284.602,49 €	18.764,23 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	37.186,56 €	5,12 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	4.170.269,34 €	574,18 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	132.114.333,15 €	18.190,05 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	18,190050%	18,190050%

II. BONOS B ES0347598015	Sobre 72 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (01/10/2007):	7.200.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	3.201.222,24 €	44.461,42 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	3.301,20 €	45,85 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	97.957,44 €	1.360,52 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	3.103.264,80 €	43.100,90 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	43,100900%	43,100900%

III. BONOS C ES0347598023	Sobre 165 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (01/10/2007):	16.500.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	7.336.134,30 €	44.461,42 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	28.891,50 €	175,10 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	224.485,80 €	1.360,52 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	7.111.648,50 €	43.100,90 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	43,100900%	43,100900%

IV. EL FONDO	Importes en euros	
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 30/06/20:		
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:		142.329.218,34 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:		101.368,06 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:		142.372.377,34 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:		126.338,21 €
2. Amortización del período 31/03/20 a 30/06/20:		4.502.445,27 €
a) Según calendario:		3.293.388,35 €
b) Amortización anticipada hasta 30/06/20:		1.209.056,92 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):		
a) Último año:		3,77%
b) Último semestre:		3,82%
c) Último trimestre:		3,25%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:		0,18%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:		0,20%
6. Porcentaje de fallidos (1):		0,09%
7. Nivel de Impago (2)		0,27%

(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: 2733/20

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

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

CAIXA PENEDES 2 TDAInfoinver.trimJul20

CAIXA PENEDES TDA 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 28/04/20-28/07/20
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 (3,77% TAA)	28 de enero de 2025
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)	132.114.333,15 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	18.190,05 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0347598015
Nominal en circulación total (inicial)	7.200.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	3.103.264,80 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	43.100,90 Euros
Serie C:	
Código ISIN	ES0347598023
Nominal en circulación total (inicial)	16.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	7.111.648,50 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	43.100,90 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA

* Liquidación del Período:28/04/20-28/07/20
* Flujos de Caja del Período:28/04/20-28/07/20
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 28 de Julio de 2020

CAIXA PENEDES TDA 2*Fondo de Titulización de Activos***FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 28/04/20 - 28/07/20**

	Euros	
	Ingresos	Pagos
I. INVERSIONES/FINANCIACIONES		
Amortización Bonos Titulización Hip.		4.492.712,58
Amortización Participaciones Hip.	4.502.445,27	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		69.379,26
Intereses recibidos de las PHs	564.465,05	
Intereses Ptmos. Subordinados		16.850,17
Intereses Inversiones Temporales	-16.332,48	
III. GASTOS		
Comisiones Periódicas:		22.632,50
Neto SWAP		9.864,55
Remuneración Variable Préstamo Participativo		439.138,78
Total Ingresos/Pagos	5.050.577,84	5.050.577,84
Saldo inicial 28/04/20	8.250.000,00	
A Inversiones Temporales		8.250.000,00
Total	13.300.577,84	13.300.577,84
Retenciones practicadas el 28/07/20	13.182,07	
A Inversiones Temporales		13.182,07

**Nº: 2739/20**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

CAIXA PENEDES 2 TDA\fluj.trim\Jul20