

## BBVA-5 FTPYME Fondo de Titulización de Activos

### Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

### Distribución por Indices de Referencia / Distribution by Reference Indexes

Activos / Assets: Préstamos a PYMES / SME Loans

Fecha / Date: 31/10/2014

Divisa / Currency: EUR

| Indices de Referencia<br>Reference Indexes  | Saldo Vivo de Principal<br>Outstanding Principal Balance |              |                       |              | Principal Vencido Impagado<br>Overdue Principal |              |                      |              | Principal Pendiente Vencimiento<br>Outstanding Principal |              |                      |              | Tipo Int.<br>Int. Rate | Margen s/Índice<br>Margin o/Index |        |       |
|---|--|--------------|-----------------------|--------------|---|--------------|----------------------|--------------|--|--------------|----------------------|--------------|------------------------|-----------------------------------|--------|-------|
|   | Num.   | %            | Importe / Amount      | %            | Num.  | %            | Importe / Amount     | %            | Num.   | %            | Importe / Amount     | %            | Med.Pond.<br>W. Avg.   | M.Pond.<br>W. Avg.                | Min.   | Max.  |
| <b>Interés Variable</b><br><i>Floating Interest</i>                                     | <b>974</b>   | <b>88,38</b> | <b>101.059.299,37</b> | <b>94,22</b> | <b>436</b>                                      | <b>80,29</b> | <b>29.221.723,56</b> | <b>87,32</b> | <b>632</b>   | <b>96,34</b> | <b>71.837.575,81</b> | <b>97,35</b> | <b>1,701%</b>          |                                   |        |       |
| EURIBOR/MIBOR a 1 mes<br><i>1-month EURIBOR/MIBOR</i>                                   | 8  | 0,73         | 603.382,06            | 0,56         | 4   | 0,74         | 251.486,22           | 0,75         | 6  | 0,91         | 351.895,84           | 0,48         | 2,058%                 | 0,915                             | 0,750  | 1,250 |
| EURIBOR/MIBOR a 2 meses<br><i>2-month EURIBOR/MIBOR</i>                                 | 1  | 0,09         | 165.279,30            | 0,15         | 0   | 0,00         | 0,00                 | 0,00         | 1  | 0,15         | 165.279,30           | 0,22         | 1,072%                 | 0,875                             | 0,875  | 0,875 |
| EURIBOR/MIBOR a 3 meses<br><i>3-month EURIBOR/MIBOR</i>                                 | 133  | 12,07        | 23.002.839,98         | 21,45        | 40  | 7,37         | 6.610.593,23         | 19,75        | 110  | 16,77        | 16.392.246,75        | 22,21        | 1,771%                 | 0,700                             | 0,250  | 2,500 |
| EURIBOR/MIBOR a 4 meses<br><i>4-month EURIBOR/MIBOR</i>                                 | 3  | 0,27         | 52.872,03             | 0,05         | 2   | 0,37         | 41.574,20            | 0,12         | 1  | 0,15         | 11.297,83            | 0,02         | 1,500%                 | 1,000                             | 1,000  | 1,250 |
| EURIBOR/MIBOR a 6 meses<br><i>6-month EURIBOR/MIBOR</i>                                 | 383  | 34,75        | 26.920.253,56         | 25,10        | 261   | 48,07        | 13.021.784,19        | 38,91        | 143  | 21,80        | 13.898.469,37        | 18,84        | 1,546%                 | 0,574                             | -0,100 | 3,000 |
| EURIBOR/MIBOR a 7 meses<br><i>7-month EURIBOR/MIBOR</i>                                 | 1  | 0,09         | 32.654,69             | 0,03         | 0   | 0,00         | 0,00                 | 0,00         | 1  | 0,15         | 32.654,69            | 0,04         | 2,000%                 | 0,750                             | 0,750  | 0,750 |
| EURIBOR/MIBOR a 9 meses<br><i>9-month EURIBOR/MIBOR</i>                                 | 1  | 0,09         | 158.620,57            | 0,15         | 0   | 0,00         | 0,00                 | 0,00         | 1  | 0,15         | 158.620,57           | 0,21         | 1,004%                 | 0,600                             | 0,600  | 0,600 |
| EURIBOR/MIBOR a 10 meses<br><i>10-month EURIBOR/MIBOR</i>                               | 1  | 0,09         | 2.606,54              | 0,00         | 1   | 0,18         | 2.606,54             | 0,01         | 0  | 0,00         | 0,00                 | 0,00         | - %                    | 0,000                             | 1,000  | 1,000 |
| EURIBOR/MIBOR a 11 meses<br><i>11-month EURIBOR/MIBOR</i>                               | 1  | 0,09         | 11.268,51             | 0,01         | 1   | 0,18         | 11.268,51            | 0,03         | 0  | 0,00         | 0,00                 | 0,00         | - %                    | 0,000                             | 3,000  | 3,000 |
| EURIBOR/MIBOR a 1 año<br><i>1-year EURIBOR/MIBOR</i>                                    | 211  | 19,15        | 28.648.861,28         | 26,71        | 90  | 16,57        | 6.980.608,81         | 20,86        | 152  | 23,17        | 21.668.252,47        | 29,36        | 1,793%                 | 0,758                             | 0,200  | 3,000 |
| EURIBOR/MIBOR a 1 año (M. Hipotecario)<br><i>1-year EURIBOR/MIBOR (Mortgage Market)</i> | 204  | 18,51        | 20.424.764,29         | 19,04        | 31  | 5,71         | 2.205.577,35         | 6,59         | 194  | 29,57        | 18.219.186,94        | 24,69        | 1,555%                 | 0,640                             | 0,250  | 2,500 |
| M. Hipotecario Bancos<br><i>Mortgage Market: Banks</i>                                  | 17   | 1,54         | 516.661,29            | 0,48         | 3   | 0,55         | 73.513,95            | 0,22         | 14   | 2,13         | 443.147,34           | 0,60         | 3,571%                 | 0,228                             | 0,000  | 1,000 |
| M. Hipotecario Conjunto de Entidades<br><i>Mortgage Market: All Institutions</i>        | 10   | 0,91         | 519.235,27            | 0,48         | 3   | 0,55         | 22.710,56            | 0,07         | 9  | 1,37         | 496.524,71           | 0,67         | 3,631%                 | 0,119                             | -0,250 | 1,000 |
| <b>Interés Fijo</b><br><i>Fixed Interest</i>  | <b>128</b>   | <b>11,62</b> | <b>6.195.553,64</b>   | <b>5,78</b>  | <b>107</b>                                      | <b>19,71</b> | <b>4.242.746,19</b>  | <b>12,68</b> | <b>24</b>  | <b>3,66</b>  | <b>1.952.807,45</b>  | <b>2,65</b>  | <b>3,450%</b>          |                                   |        |       |

## BBVA-5 FTPYME Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / *Portfolio of Securitised Assets*

Distribución por Indices de Referencia / *Distribution by Reference Indexes*

Activos / *Assets*: Préstamos a PYMES / *SME Loans*

Fecha / *Date*: 31/10/2014

Divisa / *Currency*: EUR

| Indices de Referencia<br><i>Reference Indexes</i> | Saldo Vivo de Principal<br><i>Outstanding Principal Balance</i> |        |                         |        | Principal Vencido Impagado<br><i>Overdue Principal</i> |        |                         |        | Principal Pendiente Vencimiento<br><i>Outstanding Principal</i> |        |                         |        | Tipo Int.<br><i>Int. Rate</i> | Margen s/Indice<br><i>Margin o/Index</i> |      |      |
|---|---|--------|-------------------------|--------|--|--------|-------------------------|--------|---|--------|-------------------------|--------|-------------------------------|--|------|------|
|   | Num.  | %      | Importe / <i>Amount</i> | %      | Num.   | %      | Importe / <i>Amount</i> | %      | Num.  | %      | Importe / <i>Amount</i> | %      | Med.Pond.<br><i>W. Avg.</i>   | M.Pond.<br><i>W. Avg.</i>                | Min. | Max. |
| Total :   | 1.102   | 100,00 | 107.254.853,01          | 100,00 | 543  | 100,00 | 33.464.469,75           | 100,00 | 656   | 100,00 | 73.790.383,26           | 100,00 |                               |  |      |      |
| Media Ponderada / <i>Weighted Average</i> :       |   |        |                         |        |  |        |                         |        |   |        |                         |        | 1,748%                        |  |      |      |
| Media Simple / <i>Average</i> :                   |   |        | 97.327,45               |        |  |        | 61.628,86               |        |   |        | 112.485,34              |        | 2,686%                        |  |      |      |
| Mínimo / <i>Minimum</i> :                         |   |        | 1,00                    |        |  |        | 1,00                    |        |   |        | 586,31                  |        | 0,413%                        |  |      |      |
| Máximo / <i>Maximum</i> :                         |   |        | 4.770.685,58            |        |  |        | 2.663.793,28            |        |   |        | 4.770.685,58            |        | 7,936%                        |  |      |      |