

BBVA RMBS 2 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 hipotecarios vivienda (CTHs) / Residential mortgage loans

Fecha / Date: 31/12/2011

Divisa / Currency: EUR

Indices de Referencia Reference Indexes	Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance				Principal Vencido Impagado Overdue Principal				Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal				Tipo Int. Int. Rate	Margen s/Indice Margin o/Index		
	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Med.Pond. W. Avg.	M.Pond. W. Avg.	Min.	Max.
Interés Variable Floating Interest	27.628	100,00	3.301.638.354,06	100,00	3.173	100,00	3.693.931,81	100,00	27.628	100,00	3.297.944.422,25	100,00	2,813%			
EURIBOR/MIBOR a 1 año (M. Hipotecario) 1-year EURIBOR/MIBOR (Mortgage Market)	26.605	96,30	3.180.754.935,81	96,34	2.880	90,77	3.252.371,30	88,05	26.605	96,30	3.177.502.564,51	96,35	2,791%	0,684	0,000	2,150
M. Hipotecario Bancos Mortgage Market: Banks	116	0,42	10.538.677,60	0,32	21	0,66	7.701,04	0,21	116	0,42	10.530.976,56	0,32	3,282%	0,060	0,000	2,000
M. Hipotecario Conjunto de Entidades Mortgage Market: All Institutions	907	3,28	110.344.740,65	3,34	272	8,57	433.859,47	11,75	907	3,28	109.910.881,18	3,33	3,399%	0,083	0,000	1,500
Total :	27.628	100,00	3.301.638.354,06	100,00	3.173	100,00	3.693.931,81	100,00	27.628	100,00	3.297.944.422,25	100,00				
Media Ponderada / Weighted Average :													2,813%			
Media Simple / Average :			119.503,34				1.164,18				119.369,64		2,813%			
Mínimo / Minimum :			1.704,35				0,02				1.704,35		1,693%			
Máximo / Maximum :			460.024,50				45.226,04				460.024,50		5,800%			