

BBVA RMBS 2 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Intervalos de Fecha de Vencimiento Final / Distribution by Final Maturity Date Intervals

Activos / Assets: Préstamos hipotecarios vivienda (CTHs) / Residential mortgage loans

Fecha / Date: 31/12/2011

Divisa / Currency: EUR

Intervalos anuales Annual Intervals	Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance				Principal Vencido Impagado Overdue Principal				Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal				Tipo Interés Interest Rate	Vida residual Residual Life
	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Media POND. W. Average	M. POND. Meses W. Avg. Months
2012	20	0,07	182.766,78	0,01	0	0,00	0,00	0,00	20	0,07	182.766,78	0,01	2,684%	9,768
2013	26	0,09	476.063,10	0,01	1	0,03	2.909,97	0,08	26	0,09	473.153,13	0,01	2,808%	19,207
2014	45	0,16	1.278.548,17	0,04	1	0,03	672,17	0,02	45	0,16	1.277.876,00	0,04	2,656%	32,688
2015	73	0,26	2.801.042,67	0,08	2	0,06	1.618,13	0,04	73	0,26	2.799.424,54	0,08	2,771%	42,849
2016	91	0,33	4.024.087,98	0,12	4	0,13	12.746,38	0,35	91	0,33	4.011.341,60	0,12	2,793%	54,319
2017	82	0,30	3.498.888,44	0,11	6	0,19	5.397,49	0,15	82	0,30	3.493.490,95	0,11	2,730%	66,920
2018	151	0,55	8.364.086,37	0,25	4	0,13	2.397,25	0,06	151	0,55	8.361.689,12	0,25	2,714%	79,355
2019	243	0,88	13.725.374,00	0,42	14	0,44	31.803,88	0,86	243	0,88	13.693.570,12	0,42	2,732%	90,829
2020	274	0,99	17.900.553,58	0,54	14	0,44	15.430,31	0,42	274	0,99	17.885.123,27	0,54	2,816%	103,168
2021	224	0,81	16.890.074,49	0,51	8	0,25	14.956,74	0,40	224	0,81	16.875.117,75	0,51	2,813%	114,142
2022	207	0,75	15.744.231,51	0,48	12	0,38	17.579,18	0,48	207	0,75	15.726.652,33	0,48	2,736%	126,901
2023	427	1,55	32.750.604,28	0,99	14	0,44	12.212,34	0,33	427	1,55	32.738.391,94	0,99	2,778%	139,771
2024	812	2,94	66.570.199,05	2,02	65	2,05	82.698,01	2,24	812	2,94	66.487.501,04	2,02	2,715%	150,821
2025	847	3,07	81.687.104,47	2,47	79	2,49	127.569,87	3,45	847	3,07	81.559.534,60	2,47	2,797%	162,711
2026	509	1,84	50.526.096,35	1,53	43	1,36	46.985,28	1,27	509	1,84	50.479.111,07	1,53	2,810%	173,598
2027	356	1,29	36.094.989,94	1,09	17	0,54	12.737,54	0,34	356	1,29	36.082.252,40	1,09	2,719%	186,942
2028	742	2,69	71.453.057,26	2,16	49	1,54	49.650,04	1,34	742	2,69	71.403.407,22	2,17	2,744%	199,447
2029	1.424	5,15	140.264.013,22	4,25	123	3,88	172.771,69	4,68	1.424	5,15	140.091.241,53	4,25	2,730%	210,660
2030	1.303	4,72	148.706.578,63	4,50	115	3,62	113.092,94	3,06	1.303	4,72	148.593.485,69	4,51	2,812%	222,605
2031	747	2,70	88.359.032,50	2,68	73	2,30	73.824,63	2,00	747	2,70	88.285.207,87	2,68	2,837%	233,626
2032	511	1,85	62.855.314,26	1,90	25	0,79	25.493,14	0,69	511	1,85	62.829.821,12	1,91	2,720%	246,585
2033	1.702	6,16	188.884.461,44	5,72	126	3,97	102.474,85	2,77	1.702	6,16	188.781.986,59	5,72	2,767%	260,327
2034	6.389	23,13	774.486.612,34	23,46	778	24,52	847.812,22	22,95	6.389	23,13	773.638.800,12	23,46	2,760%	270,980
2035	6.353	22,99	854.263.253,68	25,87	869	27,39	1.051.995,62	28,48	6.353	22,99	853.211.258,06	25,87	2,832%	282,531
2036	2.894	10,47	415.071.440,16	12,57	473	14,91	576.526,84	15,61	2.894	10,47	414.494.913,32	12,57	2,924%	291,757
2037	12	0,04	1.852.572,16	0,06	1	0,03	1.445,83	0,04	12	0,04	1.851.126,33	0,06	2,787%	306,147
2038	21	0,08	3.451.211,77	0,10	1	0,03	264,05	0,01	21	0,08	3.450.947,72	0,10	2,875%	319,662
2039	21	0,08	2.808.061,33	0,09	4	0,13	8.497,18	0,23	21	0,08	2.799.564,15	0,08	2,890%	331,334
2040	91	0,33	14.493.771,28	0,44	12	0,38	6.866,48	0,19	91	0,33	14.486.904,80	0,44	2,787%	344,634
2041	73	0,26	11.142.475,17	0,34	23	0,72	29.841,15	0,81	73	0,26	11.112.634,02	0,34	2,924%	351,619

Medias ponderadas por el principal pendiente de vencimiento / Averages weighted by the outstanding principal.

Tipo Interés: Tipo de interés nominal anual / Interest Rate: Annual nominal interest rate.

BBVA RMBS 2 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / *Portfolio of Securitised Assets*

Distribución por Intervalos de Fecha de Vencimiento Final / *Distribution by Final Maturity Date Intervals*

Activos / *Assets*: Préstamos hipotecarios vivienda (CTHS) / *Residential mortgage loans*

Fecha / *Date*: 31/12/2011

Divisa / *Currency*: EUR

Intervalos anuales <i>Annual Intervals</i>	Saldo Vivo de Principal <i>Outstanding Principal Balance</i>				Principal Vencido Impagado <i>Overdue Principal</i>				Principal Pendiente Vencimiento <i>Outstanding Principal</i>				Tipo Interés <i>Interest Rate</i>	Vida residual <i>Residual Life</i>
	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Media Pond. <i>W. Average</i>	M. Pond. Meses <i>W. Avg. Months</i>
2042	15	0,05	2.673.753,29	0,08	3	0,09	1.569,41	0,04	15	0,05	2.672.183,88	0,08	2,827%	366,780
2043	29	0,10	4.812.853,84	0,15	2	0,06	799,30	0,02	29	0,10	4.812.054,54	0,15	2,849%	380,294
2044	53	0,19	7.775.407,35	0,24	6	0,19	1.904,92	0,05	53	0,19	7.773.502,43	0,24	2,785%	391,173
2045	391	1,42	69.598.682,34	2,11	79	2,49	40.219,22	1,09	391	1,42	69.558.463,12	2,11	2,861%	405,331
2046	470	1,70	86.171.090,86	2,61	127	4,00	201.167,76	5,45	470	1,70	85.969.923,10	2,61	3,043%	411,768
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 / <i>Weighted Average</i> :													2,813%	262,694
Media Simple / <i>Average</i> :			119.503,34				1.164,18				119.369,64		2,813%	250,424
Mínimo / <i>Minimum</i> :			1.704,35				0,02				1.704,35		1,693%	31/03/2012
Máximo / <i>Maximum</i> :			460.024,50				45.226,04				460.024,50		5,800%	31/12/2046