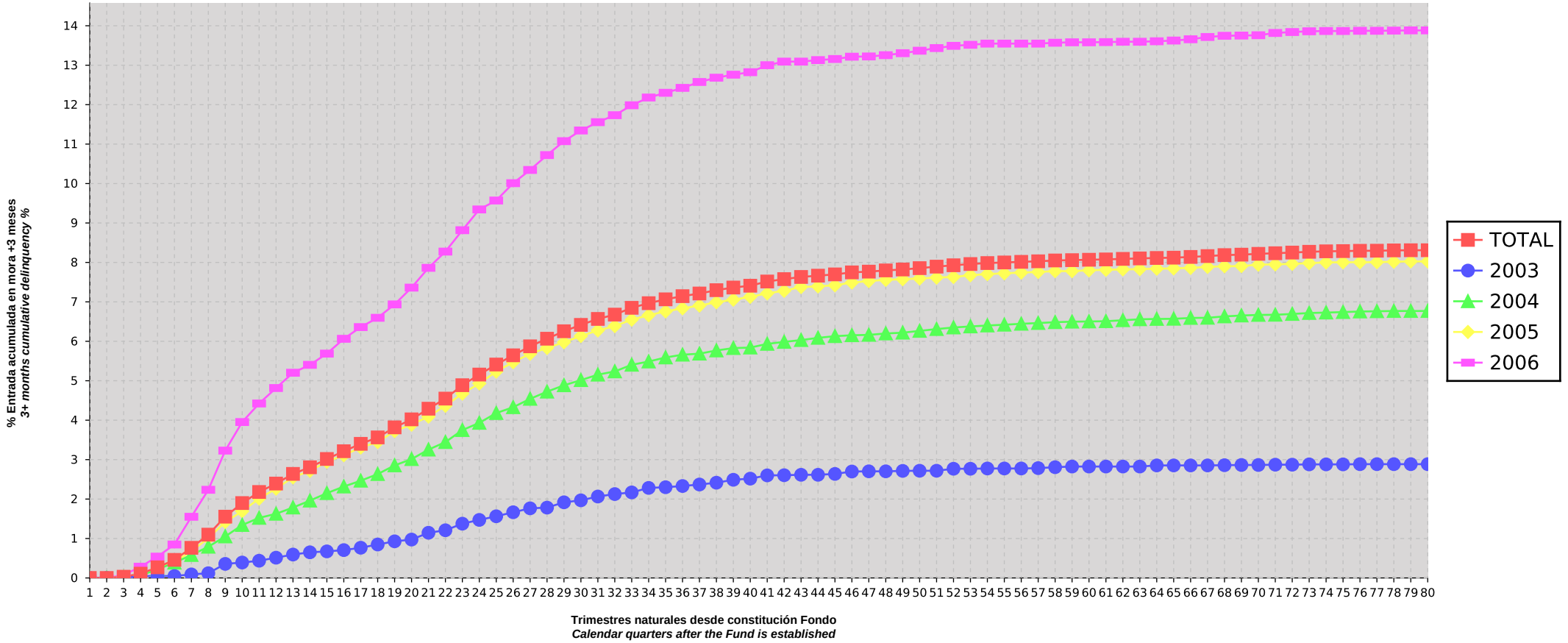
BBVA RMBS 2 Fondo de Titulización de Activos

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

Análisis de Morosidad: Tasa de entrada acumulada en mora +3 meses (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos
Delinquency analysis: 3+ months cumulative delinquency rate (calendar quarters after the Fund is established) - Detailed by asset origination years

Activos / ***Assets:*** **Préstamos hipotecarios vivienda (PHs/CTHs) /** ***Residential mortgage loans (PTCs/MCs)***
Fecha / ***Date:*** **31/10/2026**
Divisa / ***Currency:*** **EUR**

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad / *This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates*



BBVA RMBS 2 Fondo de Titulización de Activos

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

Análisis de Morosidad: Tasa de entrada acumulada en mora +3 meses (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos
Delinquency analysis: 3+ months cumulative delinquency rate (calendar quarters after the Fund is established) - Detailed by asset origination years

Activos / ***Assets:*** **Préstamos hipotecarios vivienda (PHs/CTHs) /** ***Residential mortgage loans (PTCs/MCs)***
Fecha / ***Date:*** **31/10/2026**
Divisa / ***Currency:*** **EUR**

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad / *This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates*

Originación activo *Asset origination*	TOTAL		2003		2004		2005		2006	
Principal titulizado (mill. €) *Principal securitised (€ million)*	5.000,000		372,240		1.734,887		1.951,798		941,075	
Nº activos / *Nº. of assets*	35.077		3.176		13.067		13.022		5.812	
1	0,00%	0	0,00%	0	0,00%	0	0,00%	0	0,00%	0
2	0,00%	0	0,00%	0	0,00%	0	0,00%	0	0,00%	0
3	0,03%	13	0,00%	0	0,02%	3	0,03%	5	0,07%	5
4	0,11%	36	0,05%	2	0,06%	8	0,08%	13	0,29%	13
5	0,27%	87	0,05%	2	0,22%	24	0,23%	33	0,54%	28
6	0,46%	152	0,05%	2	0,39%	45	0,41%	57	0,85%	48
7	0,76%	247	0,09%	4	0,58%	68	0,68%	89	1,55%	86
8	1,10%	353	0,12%	6	0,79%	93	1,01%	132	2,24%	122
9	1,55%	494	0,36%	12	1,05%	128	1,42%	182	3,23%	172
10	1,90%	598	0,39%	13	1,34%	160	1,69%	216	3,95%	209
11	2,18%	686	0,44%	14	1,52%	183	2,01%	256	4,42%	233
12	2,39%	751	0,51%	16	1,63%	196	2,27%	286	4,82%	253
13	2,64%	832	0,59%	19	1,79%	216	2,55%	322	5,20%	275
14	2,81%	890	0,65%	21	1,96%	238	2,72%	344	5,40%	287
15	3,02%	954	0,67%	22	2,15%	259	2,95%	371	5,69%	302
16	3,21%	1020	0,71%	23	2,32%	282	3,11%	392	6,06%	323
17	3,40%	1084	0,77%	25	2,47%	304	3,31%	416	6,36%	339
18	3,56%	1143	0,85%	29	2,63%	327	3,45%	435	6,60%	352
19	3,82%	1233	0,93%	31	2,85%	356	3,72%	470	6,94%	376
20	4,02%	1305	0,97%	33	3,01%	378	3,89%	493	7,36%	401
21	4,29%	1398	1,15%	38	3,25%	408	4,09%	523	7,86%	429
22	4,55%	1489	1,21%	40	3,44%	434	4,37%	562	8,27%	453
23	4,89%	1610	1,38%	45	3,75%	477	4,67%	605	8,82%	483
24	5,16%	1707	1,47%	47	3,93%	508	4,93%	643	9,34%	509
25	5,41%	1804	1,56%	50	4,18%	547	5,23%	683	9,57%	524

BBVA RMBS 2 Fondo de Titulización de Activos

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

Análisis de Morosidad: Tasa de entrada acumulada en mora +3 meses (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos
Delinquency analysis: 3+ months cumulative delinquency rate (calendar quarters after the Fund is established) - Detailed by asset origination years

Activos / ***Assets:*** **Préstamos hipotecarios vivienda (PHs/CTHs) /** ***Residential mortgage loans (PTCs/MCs)***
Fecha / ***Date:*** **31/10/2026**
Divisa / ***Currency:*** **EUR**

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad / *This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates*

	TOTAL		2003		2004		2005		2006	
26	5,64%	1889	1,67%	53	4,33%	569	5,47%	717	10,01%	550
27	5,87%	1971	1,77%	57	4,54%	599	5,68%	745	10,34%	570
28	6,07%	2052	1,78%	58	4,72%	629	5,83%	770	10,72%	595
29	6,25%	2124	1,92%	63	4,88%	655	5,98%	791	11,07%	615
30	6,42%	2182	1,97%	65	5,02%	674	6,13%	812	11,34%	631
31	6,57%	2248	2,06%	69	5,15%	697	6,28%	838	11,56%	644
32	6,68%	2292	2,13%	72	5,24%	712	6,39%	853	11,73%	655
33	6,85%	2363	2,17%	74	5,40%	739	6,55%	876	11,98%	674
34	6,97%	2412	2,28%	78	5,49%	752	6,66%	894	12,18%	688
35	7,06%	2457	2,30%	79	5,59%	774	6,76%	907	12,30%	697
36	7,14%	2493	2,33%	80	5,66%	787	6,84%	920	12,43%	706
37	7,21%	2520	2,37%	82	5,69%	793	6,91%	931	12,57%	714
38	7,30%	2559	2,42%	84	5,77%	808	6,99%	945	12,68%	722
39	7,36%	2590	2,49%	87	5,83%	820	7,06%	955	12,76%	728
40	7,41%	2611	2,52%	89	5,84%	823	7,13%	966	12,82%	733
41	7,52%	2652	2,60%	92	5,93%	838	7,22%	980	13,00%	742
42	7,58%	2681	2,60%	93	5,99%	848	7,28%	990	13,09%	750
43	7,63%	2701	2,62%	94	6,03%	854	7,38%	1003	13,09%	750
44	7,66%	2716	2,62%	94	6,09%	863	7,39%	1006	13,13%	753
45	7,70%	2733	2,64%	95	6,13%	872	7,42%	1011	13,16%	755
46	7,75%	2764	2,70%	98	6,15%	878	7,49%	1026	13,22%	762
47	7,77%	2776	2,70%	99	6,16%	881	7,53%	1033	13,22%	763
48	7,80%	2789	2,70%	99	6,20%	888	7,56%	1038	13,25%	764
49	7,82%	2802	2,71%	100	6,22%	893	7,57%	1041	13,30%	768
50	7,86%	2817	2,72%	101	6,26%	899	7,59%	1045	13,37%	772
51	7,89%	2834	2,72%	101	6,31%	906	7,62%	1050	13,43%	777
52	7,93%	2850	2,77%	103	6,35%	912	7,63%	1052	13,49%	783
53	7,96%	2865	2,77%	103	6,38%	917	7,68%	1059	13,52%	786
54	7,98%	2883	2,78%	104	6,40%	923	7,70%	1067	13,55%	789
55	8,00%	2892	2,78%	104	6,42%	928	7,72%	1071	13,55%	789
56	8,01%	2899	2,78%	104	6,44%	932	7,74%	1074	13,55%	789
57	8,03%	2909	2,78%	105	6,46%	938	7,76%	1077	13,55%	789

BBVA RMBS 2 Fondo de Titulización de Activos

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

Análisis de Morosidad: Tasa de entrada acumulada en mora +3 meses (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos
Delinquency analysis: 3+ months cumulative delinquency rate (calendar quarters after the Fund is established) - Detailed by asset origination years

Activos / ***Assets:*** **Préstamos hipotecarios vivienda (PHs/CTHs) /** ***Residential mortgage loans (PTCs/MCs)***
Fecha / ***Date:*** **31/10/2026**
Divisa / ***Currency:*** **EUR**

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad / *This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates*

	TOTAL		2003		2004		2005		2006	
58	8,05%	2923	2,81%	106	6,48%	943	7,78%	1083	13,57%	791
59	8,06%	2928	2,82%	107	6,50%	946	7,78%	1083	13,58%	792
60	8,07%	2933	2,82%	107	6,50%	947	7,80%	1087	13,58%	792
61	8,08%	2939	2,82%	107	6,51%	949	7,81%	1090	13,59%	793
62	8,09%	2947	2,82%	107	6,53%	953	7,82%	1092	13,59%	795
63	8,10%	2956	2,82%	107	6,56%	959	7,83%	1095	13,59%	795
64	8,11%	2966	2,85%	109	6,57%	961	7,84%	1100	13,61%	796
65	8,12%	2970	2,85%	109	6,57%	962	7,85%	1101	13,63%	798
66	8,14%	2981	2,85%	109	6,59%	966	7,86%	1105	13,66%	801
67	8,16%	2992	2,85%	109	6,60%	967	7,89%	1109	13,72%	807
68	8,19%	3011	2,86%	110	6,63%	976	7,90%	1114	13,75%	811
69	8,20%	3024	2,86%	111	6,65%	985	7,91%	1116	13,75%	812
70	8,22%	3039	2,86%	111	6,67%	991	7,94%	1124	13,76%	813
71	8,23%	3050	2,87%	112	6,67%	992	7,95%	1127	13,82%	819
72	8,25%	3062	2,87%	112	6,69%	999	7,96%	1130	13,84%	821
73	8,27%	3077	2,88%	113	6,72%	1005	7,98%	1137	13,86%	822
74	8,28%	3087	2,88%	113	6,73%	1009	8,00%	1142	13,87%	823
75	8,29%	3093	2,88%	113	6,74%	1013	8,00%	1144	13,87%	823
76	8,29%	3102	2,89%	114	6,76%	1018	8,01%	1146	13,87%	824
77	8,30%	3106	2,89%	114	6,76%	1021	8,01%	1147	13,87%	824
78	8,30%	3113	2,89%	114	6,77%	1023	8,02%	1151	13,88%	825
79	8,31%	3117	2,89%	114	6,77%	1023	8,03%	1154	13,88%	826
80	8,31%	3117	2,89%	114	6,77%	1023	8,03%	1154	13,88%	826

BBVA RMBS 2 Fondo de Titulización de Activos

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

Análisis de Morosidad: Tasa de entrada acumulada en mora +3 meses (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos
Delinquency analysis: 3+ months cumulative delinquency rate (calendar quarters after the Fund is established) - Detailed by asset origination years

Activos / ***Assets:*** **Préstamos hipotecarios vivienda (PHs/CTHs) /** ***Residential mortgage loans (PTCs/MCs)***
Fecha / ***Date:*** **31/10/2026**
Divisa / ***Currency:*** **EUR**

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad / *This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates*