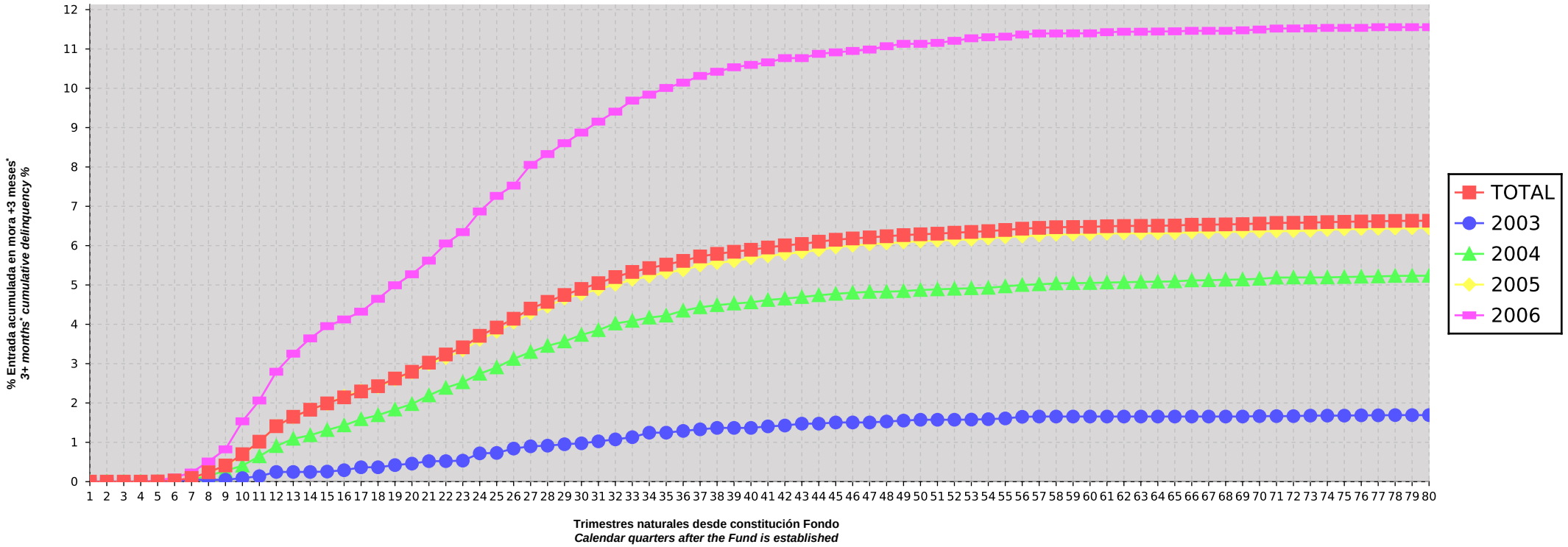
BBVA RMBS 2 Fondo de Titulización de Activos

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

Análisis de Morosidad: Tasa de entrada acumulada en dudoso +12 meses* (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos
Delinquency analysis: 12+ 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*



*Incluye en su caso los activos titulizados clasificados como dudosos/fallidos por duda razonable sobre reembolso total. En los informes generados a partir de agosto de 2015, incluye además los activos titulizados dados de baja por adjudicación judicial o dación en pago de los inmuebles hipotecados, aunque se encontraran en mora por un periodo inferior al analizado en este informe. Para el cómputo de estos activos titulizados se contempla la fecha en la que se contabiliza la adjudicación o dación en pago del inmueble y el saldo vivo del principal inmediatamente anterior a esa fecha.

**Includes, as the case may be, securitised assets classified as doubtful/bad debts because full repayment thereof is reasonably to be doubted. In reports generated from August 2015 this moreover includes securitised assets removed following an award by the court or accepted in lieu of foreclosure of the mortgaged properties, even if they had been in arrears for a period shorter than that analysed in this report. Computation of those securitised assets takes into account both the date on which the award or acceptance in lieu of foreclosure of the property is booked and the outstanding principal balance immediately before that date.*

BBVA RMBS 2 Fondo de Titulización de Activos

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

Análisis de Morosidad: Tasa de entrada acumulada en dudoso +12 meses* (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos
Delinquency analysis: 12+ 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	0,00%	0	0,00%	0	0,00%	0	0,00%	0	0,00%	0
4	0,00%	0	0,00%	0	0,00%	0	0,00%	0	0,00%	0
5	0,00%	1	0,00%	0	0,00%	0	0,00%	0	0,03%	1
6	0,03%	10	0,00%	0	0,01%	1	0,02%	3	0,11%	6
7	0,09%	34	0,05%	2	0,05%	7	0,08%	12	0,23%	13
8	0,24%	78	0,05%	2	0,15%	17	0,22%	31	0,51%	28
9	0,41%	135	0,05%	2	0,27%	34	0,40%	52	0,82%	47
10	0,70%	226	0,09%	4	0,41%	49	0,67%	87	1,53%	86
11	1,02%	325	0,14%	6	0,64%	77	1,01%	129	2,06%	113
12	1,41%	442	0,25%	9	0,90%	106	1,41%	175	2,79%	152
13	1,65%	516	0,25%	9	1,09%	129	1,64%	203	3,25%	175
14	1,83%	573	0,25%	9	1,18%	142	1,83%	227	3,64%	195
15	1,99%	626	0,26%	10	1,31%	160	1,98%	244	3,95%	212
16	2,14%	678	0,29%	11	1,43%	175	2,18%	270	4,12%	222
17	2,29%	731	0,37%	13	1,59%	195	2,31%	290	4,32%	233
18	2,43%	774	0,37%	13	1,69%	208	2,40%	302	4,65%	251
19	2,62%	834	0,42%	15	1,83%	226	2,60%	324	4,99%	269
20	2,79%	892	0,46%	16	1,97%	245	2,78%	346	5,27%	285

*Incluye en su caso los activos titulizados clasificados como dudosos/fallidos por duda razonable sobre reembolso total. En los informes generados a partir de agosto de 2015, incluye además los activos titulizados dados de baja por adjudicación judicial o dación en pago de los inmuebles hipotecados, aunque se encontraran en mora por un periodo inferior al analizado en este informe. Para el cómputo de estos activos titulizados se contempla la fecha en la que se contabiliza la adjudicación o dación en pago del inmueble y el saldo vivo del principal inmediatamente anterior a esa fecha.

**Includes, as the case may be, securitised assets classified as doubtful/bad debts because full repayment thereof is reasonably to be doubted. In reports generated from August 2015 this moreover includes securitised assets removed following an award by the court or accepted in lieu of foreclosure of the mortgaged properties, even if they had been in arrears for a period shorter than that analysed in this report. Computation of those securitised assets takes into account both the date on which the award or acceptance in lieu of foreclosure of the property is booked and the outstanding principal balance immediately before that date.*

BBVA RMBS 2 Fondo de Titulización de Activos

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

Análisis de Morosidad: Tasa de entrada acumulada en dudoso +12 meses* (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos
Delinquency analysis: 12+ 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	
21	3,02%	970	0,52%	18	2,19%	273	2,99%	375	5,62%	304
22	3,23%	1036	0,52%	18	2,38%	295	3,14%	394	6,05%	329
23	3,41%	1100	0,53%	19	2,53%	312	3,34%	420	6,34%	349
24	3,71%	1203	0,72%	25	2,74%	341	3,61%	461	6,87%	376
25	3,92%	1281	0,73%	26	2,90%	364	3,81%	492	7,26%	399
26	4,14%	1370	0,84%	28	3,12%	399	4,05%	530	7,53%	413
27	4,40%	1463	0,90%	30	3,30%	426	4,28%	562	8,05%	445
28	4,57%	1530	0,91%	31	3,45%	451	4,45%	586	8,33%	462
29	4,75%	1595	0,95%	32	3,56%	469	4,66%	615	8,60%	479
30	4,90%	1654	0,97%	33	3,73%	493	4,77%	631	8,87%	497
31	5,05%	1711	1,02%	35	3,85%	513	4,89%	649	9,15%	514
32	5,20%	1765	1,07%	36	4,02%	538	5,01%	664	9,41%	527
33	5,33%	1813	1,13%	38	4,09%	547	5,14%	683	9,69%	545
34	5,43%	1853	1,24%	43	4,17%	561	5,22%	696	9,84%	553
35	5,52%	1887	1,24%	43	4,22%	570	5,32%	709	10,01%	565
36	5,61%	1932	1,29%	45	4,35%	591	5,38%	719	10,14%	577
37	5,73%	1976	1,33%	46	4,43%	607	5,50%	734	10,31%	589
38	5,79%	2005	1,37%	47	4,49%	617	5,56%	743	10,42%	598
39	5,84%	2029	1,37%	47	4,53%	626	5,61%	750	10,53%	606
40	5,90%	2049	1,37%	47	4,56%	633	5,68%	760	10,60%	609
41	5,95%	2074	1,40%	49	4,62%	644	5,74%	768	10,66%	613
42	6,01%	2096	1,43%	50	4,65%	652	5,79%	775	10,77%	619
43	6,04%	2115	1,47%	52	4,69%	660	5,83%	784	10,77%	619
44	6,10%	2137	1,47%	52	4,74%	667	5,89%	794	10,88%	624
45	6,15%	2155	1,50%	53	4,78%	672	5,96%	803	10,91%	627
46	6,18%	2166	1,50%	53	4,80%	675	6,00%	808	10,95%	630
47	6,21%	2178	1,50%	53	4,82%	679	6,04%	813	10,99%	633

*Incluye en su caso los activos titulizados clasificados como dudosos/fallidos por duda razonable sobre reembolso total. En los informes generados a partir de agosto de 2015, incluye además los activos titulizados dados de baja por adjudicación judicial o dación en pago de los inmuebles hipotecados, aunque se encontraran en mora por un periodo inferior al analizado en este informe. Para el cómputo de estos activos titulizados se contempla la fecha en la que se contabiliza la adjudicación o dación en pago del inmueble y el saldo vivo del principal inmediatamente anterior a esa fecha.

**Includes, as the case may be, securitised assets classified as doubtful/bad debts because full repayment thereof is reasonably to be doubted. In reports generated from August 2015 this moreover includes securitised assets removed following an award by the court or accepted in lieu of foreclosure of the mortgaged properties, even if they had been in arrears for a period shorter than that analysed in this report. Computation of those securitised assets takes into account both the date on which the award or acceptance in lieu of foreclosure of the property is booked and the outstanding principal balance immediately before that date.*

BBVA RMBS 2 Fondo de Titulización de Activos

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

Análisis de Morosidad: Tasa de entrada acumulada en dudoso +12 meses* (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos
Delinquency analysis: 12+ 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	
48	6,24%	2193	1,53%	55	4,83%	680	6,06%	819	11,07%	639
49	6,27%	2211	1,55%	56	4,85%	686	6,09%	825	11,13%	644
50	6,29%	2222	1,57%	58	4,87%	692	6,11%	828	11,13%	644
51	6,30%	2229	1,57%	58	4,89%	696	6,13%	830	11,15%	645
52	6,33%	2243	1,57%	59	4,90%	699	6,15%	836	11,21%	649
53	6,35%	2253	1,58%	60	4,92%	703	6,16%	837	11,27%	653
54	6,37%	2263	1,59%	61	4,93%	705	6,19%	841	11,30%	656
55	6,40%	2275	1,61%	62	4,96%	711	6,22%	845	11,31%	657
56	6,43%	2293	1,65%	64	5,00%	716	6,24%	851	11,37%	662
57	6,45%	2304	1,66%	65	5,02%	720	6,26%	855	11,39%	664
58	6,47%	2311	1,66%	65	5,04%	724	6,28%	858	11,39%	664
59	6,47%	2316	1,66%	65	5,05%	726	6,29%	860	11,40%	665
60	6,48%	2320	1,66%	65	5,05%	727	6,29%	863	11,40%	665
61	6,49%	2329	1,66%	65	5,06%	729	6,31%	867	11,43%	668
62	6,50%	2333	1,66%	65	5,07%	731	6,31%	868	11,44%	669
63	6,50%	2335	1,66%	65	5,08%	733	6,31%	868	11,44%	669
64	6,51%	2338	1,66%	65	5,08%	734	6,32%	869	11,44%	670
65	6,51%	2342	1,66%	65	5,09%	736	6,32%	870	11,45%	671
66	6,53%	2353	1,66%	65	5,12%	741	6,34%	875	11,46%	672
67	6,53%	2355	1,66%	65	5,12%	742	6,34%	876	11,46%	672
68	6,54%	2358	1,66%	65	5,13%	744	6,35%	877	11,46%	672
69	6,55%	2365	1,66%	65	5,14%	747	6,36%	879	11,47%	674
70	6,56%	2376	1,67%	66	5,16%	752	6,37%	881	11,49%	677
71	6,58%	2386	1,67%	66	5,19%	759	6,37%	882	11,52%	679
72	6,58%	2390	1,67%	66	5,19%	761	6,37%	883	11,52%	680
73	6,59%	2395	1,68%	68	5,19%	761	6,38%	885	11,52%	681
74	6,60%	2401	1,68%	68	5,19%	762	6,40%	889	11,54%	682

*Incluye en su caso los activos titulizados clasificados como dudosos/fallidos por duda razonable sobre reembolso total. En los informes generados a partir de agosto de 2015, incluye además los activos titulizados dados de baja por adjudicación judicial o dación en pago de los inmuebles hipotecados, aunque se encontraran en mora por un periodo inferior al analizado en este informe. Para el cómputo de estos activos titulizados se contempla la fecha en la que se contabiliza la adjudicación o dación en pago del inmueble y el saldo vivo del principal inmediatamente anterior a esa fecha.

**Includes, as the case may be, securitised assets classified as doubtful/bad debts because full repayment thereof is reasonably to be doubted. In reports generated from August 2015 this moreover includes securitised assets removed following an award by the court or accepted in lieu of foreclosure of the mortgaged properties, even if they had been in arrears for a period shorter than that analysed in this report. Computation of those securitised assets takes into account both the date on which the award or acceptance in lieu of foreclosure of the property is booked and the outstanding principal balance immediately before that date.*

BBVA RMBS 2 Fondo de Titulización de Activos

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

Análisis de Morosidad: Tasa de entrada acumulada en dudoso +12 meses* (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos
Delinquency analysis: 12+ 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	
75	6,61%	2407	1,68%	68	5,20%	765	6,42%	892	11,54%	682
76	6,61%	2414	1,69%	69	5,21%	767	6,43%	896	11,54%	682
77	6,62%	2420	1,69%	69	5,22%	770	6,43%	898	11,55%	683
78	6,63%	2427	1,69%	70	5,23%	775	6,44%	899	11,55%	683
79	6,63%	2430	1,69%	70	5,23%	777	6,44%	900	11,55%	683
80	6,63%	2430	1,69%	70	5,23%	777	6,44%	900	11,55%	683

*Incluye en su caso los activos titulizados clasificados como dudosos/fallidos por duda razonable sobre reembolso total. En los informes generados a partir de agosto de 2015, incluye además los activos titulizados dados de baja por adjudicación judicial o dación en pago de los inmuebles hipotecados, aunque se encontraran en mora por un periodo inferior al analizado en este informe. Para el cómputo de estos activos titulizados se contempla la fecha en la que se contabiliza la adjudicación o dación en pago del inmueble y el saldo vivo del principal inmediatamente anterior a esa fecha.

**Includes, as the case may be, securitised assets classified as doubtful/bad debts because full repayment thereof is reasonably to be doubted. In reports generated from August 2015 this moreover includes securitised assets removed following an award by the court or accepted in lieu of foreclosure of the mortgaged properties, even if they had been in arrears for a period shorter than that analysed in this report. Computation of those securitised assets takes into account both the date on which the award or acceptance in lieu of foreclosure of the property is booked and the outstanding principal balance immediately before that date.*