

BBVA RMBS 2 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Índices de Referencia / Distribution by Reference Indexes

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

Fecha / Date: 31/05/2011

Divisa / Currency: EUR

Índices 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/Índice 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	28.072	100,00	3.448.739.069,79	100,00	4.212	100,00	4.860.805,16	100,00	28.071	100,00	3.443.878.264,63	100,00	2,547%			
EURIBOR/MIBOR a 1 año (M. Hipotecario) 1-year EURIBOR/MIBOR (Mortgage Market)	27.001	96,18	3.317.883.779,00	96,21	3.843	91,24	4.246.867,33	87,37	27.000	96,18	3.313.636.911,67	96,22	2,532%	0,684	0,000	2,150
M. Hipotecario Bancos Mortgage Market: Banks	117	0,42	10.838.783,64	0,31	28	0,66	12.725,27	0,26	117	0,42	10.826.058,37	0,31	2,762%	0,059	0,000	2,000
M. Hipotecario Conjunto de Entidades Mortgage Market: All Institutions	954	3,40	120.016.507,15	3,48	341	8,10	601.212,56	12,37	954	3,40	119.415.294,59	3,47	2,965%	0,087	0,000	1,500
Total :	28.072	100,00	3.448.739.069,79	100,00	4.212	100,00	4.860.805,16	100,00	28.071	100,00	3.443.878.264,63	100,00				
Media Ponderada / Weighted Average :													2,547%			
Media Simple / Average :			122.853,34				1.154,04				122.684,56		2,544%			
Mínimo / Minimum :			16,72				0,01				16,72		1,599%			
Máximo / Maximum :			467.605,55				66.166,59				467.605,55		6,744%			