

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

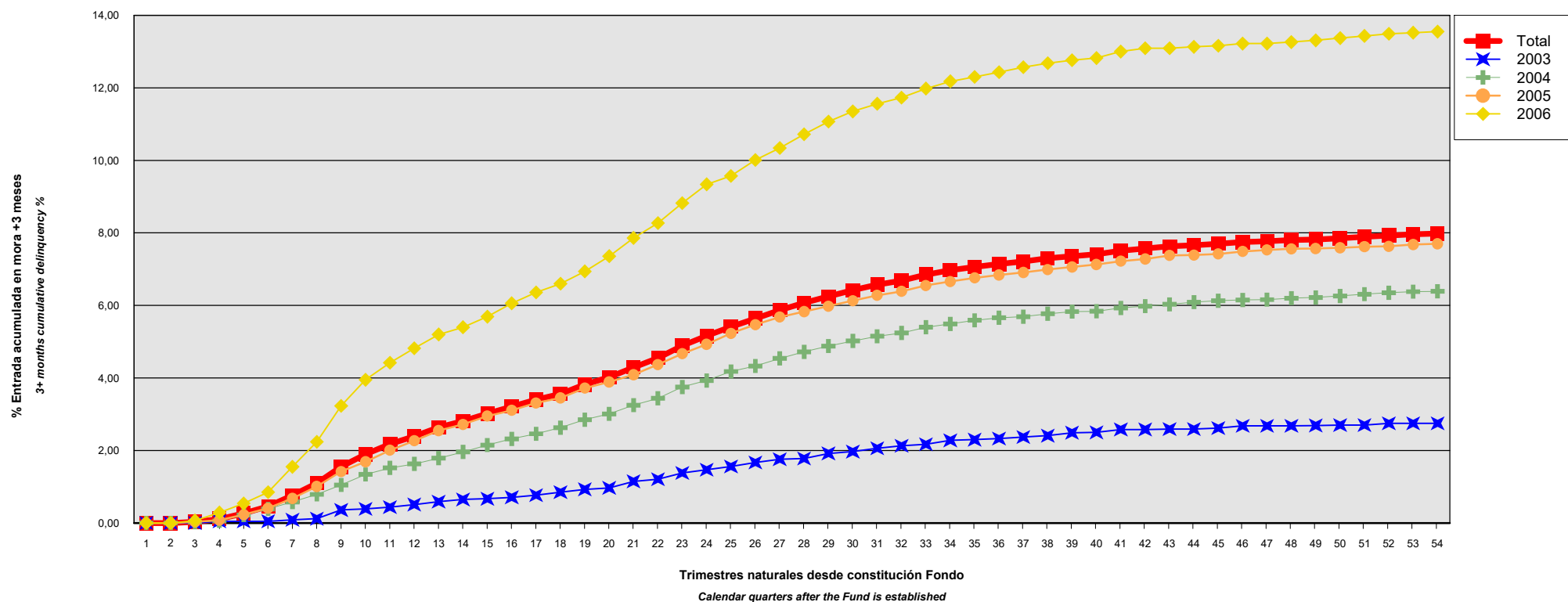
Delinquency analysis: 3+ months cumulative delinquency rate (calendar quarters after the Fund is established) - Detailed by asset origination years

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

Fecha / Date: 31/05/2020

Divisa / Currency: EUR

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros o actualización de información 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 or information update 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 (CTHs) / Residential mortgage loans (PTCs)

Fecha / Date: 31/05/2020

Divisa / Currency: EUR

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros o actualización de información 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 or information update 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 / N°. 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% 1.020	0,71% 23	2,32% 282	3,11% 392	6,06% 323
17	3,40% 1.084	0,77% 25	2,46% 304	3,31% 416	6,36% 339
18	3,56% 1.143	0,85% 29	2,63% 327	3,45% 435	6,60% 352

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 (CTHs) / Residential mortgage loans (PTCs)

Fecha / Date: 31/05/2020

Divisa / Currency: EUR

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros o actualización de información 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 or information update of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates

	Total	2003	2004	2005	2006
19	3,82%1.233	0,93% 31	2,85% 356	3,72% 470	6,94% 376
20	4,02%1.305	0,97% 33	3,01% 378	3,89% 493	7,36% 401
21	4,29%1.398	1,15% 38	3,25% 408	4,09% 523	7,86% 429
22	4,55%1.488	1,21% 40	3,44% 434	4,37% 562	8,27% 453
23	4,89%1.610	1,38% 45	3,75% 477	4,67% 605	8,82% 483
24	5,16%1.707	1,47% 47	3,93% 508	4,93% 643	9,34% 509
25	5,41%1.804	1,56% 50	4,18% 547	5,23% 683	9,57% 524
26	5,64%1.888	1,67% 53	4,33% 569	5,47% 717	10,01% 550
27	5,87%1.971	1,76% 57	4,54% 599	5,68% 745	10,34% 570
28	6,07%2.052	1,78% 58	4,72% 629	5,83% 770	10,72% 595
29	6,25%2.124	1,92% 63	4,88% 655	5,98% 791	11,07% 615
30	6,42%2.182	1,97% 65	5,02% 674	6,13% 812	11,35% 631
31	6,57%2.248	2,06% 69	5,15% 697	6,28% 838	11,56% 644
32	6,68%2.292	2,13% 72	5,24% 712	6,39% 853	11,73% 655
33	6,85%2.363	2,17% 74	5,40% 739	6,55% 876	11,98% 674
34	6,97%2.412	2,28% 78	5,49% 752	6,66% 894	12,18% 688
35	7,06%2.457	2,30% 79	5,59% 774	6,76% 907	12,30% 697
36	7,14%2.493	2,33% 80	5,66% 787	6,84% 920	12,43% 706
37	7,21%2.520	2,37% 82	5,69% 793	6,91% 931	12,57% 714
38	7,30%2.558	2,41% 84	5,77% 808	6,99% 945	12,68% 722
39	7,36%2.590	2,49% 87	5,83% 820	7,06% 955	12,76% 728
40	7,41%2.610	2,50% 88	5,84% 823	7,13% 966	12,82% 733
41	7,51%2.651	2,58% 91	5,93% 838	7,22% 980	13,00% 742
42	7,57%2.680	2,58% 92	5,98% 848	7,28% 990	13,09% 750

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 (CTHs) / Residential mortgage loans (PTCs)

Fecha / Date: 31/05/2020

Divisa / Currency: EUR

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros o actualización de información 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 or information update of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates

	Total	2003	2004	2005	2006
43	7,63% 2.700	2,59% 93	6,03% 854	7,38% 1.003	13,09% 750
44	7,66% 2.715	2,59% 93	6,09% 863	7,39% 1.006	13,13% 753
45	7,70% 2.732	2,62% 94	6,13% 872	7,42% 1.011	13,16% 755
46	7,75% 2.763	2,68% 97	6,15% 878	7,49% 1.026	13,22% 762
47	7,77% 2.775	2,68% 98	6,16% 881	7,53% 1.033	13,22% 763
48	7,80% 2.788	2,68% 98	6,20% 888	7,56% 1.038	13,26% 764
49	7,82% 2.801	2,69% 99	6,22% 893	7,57% 1.041	13,31% 768
50	7,85% 2.816	2,70% 100	6,26% 899	7,59% 1.045	13,37% 772
51	7,89% 2.833	2,70% 100	6,31% 906	7,62% 1.050	13,43% 777
52	7,93% 2.849	2,75% 102	6,35% 912	7,63% 1.052	13,49% 783
53	7,96% 2.864	2,75% 102	6,38% 917	7,68% 1.059	13,52% 786
54	7,98% 2.879	2,75% 103	6,39% 921	7,70% 1.066	13,55% 789