

MBS BANCAJA 2 FTA (C.I.F.: V84388131)

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Amortisation

FECHA DE PAGO / Payment date

25.11.2011

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

25.08.2011
25.11.2011
92

(incluido) / (included)
(excluido) / (excluded)
días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E	Bonos Serie F
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds	Series F Bonds
ES0361795000	ES0361795018	ES0361795026	ES0361795034	ES0361795042	ES0361795059

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

1,536%

1,536%

1,536%

1,536%

1,536%

1,536%

Margen / Margin

0,150%

0,240%

0,340%

0,500%

1,850%

4,000%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

1,686%

1,776%

1,876%

2,036%

3,386%

5,536%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie		
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series		
	7.544		132		104		88		132		92		
Número de Bonos / N.Bonds													
Nominal / Face value	(Euros)	31.514,06	237.742.068,64	100.000,00	13.200.000,00	100.000,00	10.400.000,00	100.000,00	8.800.000,00	100.000,00	13.200.000,00	100.000,00	9.200.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross

(Euros)

135,783580

1.024.351,33

453,866667

59.910,40

479,422222

49.859,91

520,311111

45.787,38

865,311111

114.221,07

1.414,755556

130.157,51

Interés Retención / Withholding tax

19%

25,798880

194.626,75

86,234667

11.382,98

91,090222

9.473,38

98,859111

8.699,60

164,409111

21.702,00

268,803556

24.729,93

Interés Neto / Net

109,984700

829.724,58

367,632000

48.527,42

388,332000

40.386,53

421,452000

37.087,78

700,902000

92.519,07

1.145,952000

105.427,58

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To Be Determined

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00