

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

25.08.2016

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 25.05.2016 (incluido) / (included)
 hasta / To 25.08.2016 (excluido) / (excluded)
 plazo / Term 92 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 23/05/2016 -0,258%
 Margen / Margin 0,150%
 Tipo de Interés Nominal calculado / Interest Rate -0,108%
 Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate 0,000%*

-0,258%	-0,258%	-0,258%	-0,258%	-0,258%	-0,258%
0,150%	0,240%	0,340%	0,500%	1,850%	4,000%
-0,108%	-0,018%	0,082%	0,242%	1,592%	3,742%
0,000%*	0,000%*	0,082%	0,242%	1,592%	3,742%

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
	7.544		132		104		88		132		92
15.191,19	114.602.337,36	43.431,80	5.732.997,60	62.519,98	6.502.077,92	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 Interest	Retención / Withholding tax	Neto / Net
0,000000	19,00%	0,000000
0,00	0,00	0,00
0,000000	0,00	0,000000
0,00	0,00	0,00
0,000000	0,00	0,000000
0,00	0,00	0,00
13,101409	2,489268	10,612141
1.362,55	258,88	1.103,67
61,844444	11,750444	50,094000
5.442,31	1.034,04	4.408,27
406,844444	77,300444	329,544000
53.703,47	10.203,66	43.499,81
956,288889	181,694889	774,594000
87.978,58	16.715,93	71.262,65

Amortización de Principal Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To Be Determined A determinar / To Be Determined A determinar / To Be Determined A determinar / To Be Determined A determinar / To Be Determined A determinar / To Be Determined

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles Payments not made due to insufficient Available Funds

Fecha de Vencimiento / Maturity Date

Intereses Brutos / Gross Interest (Euros)
 Retención / Withholding tax 19,00%
 Neto / Net Interest

25.05.2016

350,357500	32.232,89
66,567925	6.124,25
283,789575	26.108,64

El Tipo de Interés Nominal aplicable se ha fijado en el 0,000% debido a que los términos del Folleto y en concreto los apartados II.10 y V.4.2.1 del Folleto Informativo no contemplan la posibilidad de un Tipo de Interés Nominal negativo que pudiera dar lugar a intereses a satisfacer por los tenedores de los Bonos a favor del Fondo.

* The applicable Nominal Interest Rate has been set at 0.000% because the terms of the Prospectus and specifically sections II.10 and V.4.2.1 of the Prospectus do not provide for the possibility of a negative Nominal Interest Rate which might result in interest being payable by Bondholders to the Fund

EUROPEA DE TITULIZACIÓN, S.A., S.G.F.T

C/ Lagasca, 120 - MADRID, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67 - Fax (34) 91 411 84 68

info@edt-sg.com

www.edt-sg.com