

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

25.11.2016

Periodo de Interés /

desde / From

25.08.2016

(incluido) / (included)

Interest accrual period

hasta / To

25.11.2016

(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

23/08/2016

-0,298%

-0,298%

-0,298%

-0,298%

-0,298%

-0,298%

Margen / Margin

0,150%

0,240%

0,340%

0,500%

1,850%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Interest Rate

-0,148%

-0,058%

0,042%

0,202%

1,552%

3,702%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

0,000%*

0,000%*

0,042%

0,202%

1,552%

3,702%

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)	14.654,70	110.555.056,80	35.950,66	4.745.487,12	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

(Euros)

0,000000

0,00

0,000000

0,00

6,710478

697,89

51,622222

4.542,76

396,622222

52.354,13

946,066667

87.038,13

Interés Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

1,274991

132,60

9,808222

863,12

75,358222

9.947,29

179,752667

16.537,25

Interés Neto / Net

0,000000

0,00

0,000000

0,00

5,435487

565,29

41,814000

3.679,64

321,264000

42.406,84

766,314000

70.500,88

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

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