

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

25.02.2016

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

25.11.2015
25.02.2016
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

23/11/2015

-0,099%

-0,099%

-0,099%

-0,099%

-0,099%

-0,099%

Margen / Margin

0,150%

0,240%

0,340%

0,500%

1,850%

4,000%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

0,051%

0,141%

0,241%

0,401%

1,751%

3,901%

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)	15.191,19	114.602.337,36	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 Interest

(Euros)

1,979918

14.936,50

36,033333

4.756,40

61,588889

6.405,24

102,477778

9.018,04

447,477778

59.067,07

996,922222

91.716,84

Intereses Retención / Withholding tax

19,5%

0,386084

2.912,62

7,026500

927,50

12,009833

1.249,02

19,983167

1.758,52

87,258167

11.518,08

194,399833

17.884,78

Intereses Neto / Net Interest

1,593834

12.023,88

29,006833

3.828,90

49,579056

5.156,22

82,494611

7.259,52

360,219611

47.548,99

802,522389

73.832,06

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

0,00

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)

25.08.2015 a / to 25.11.2015

1.465,028141

134.782,59

Intereses Retención / Withholding tax

19,5%

285,680488

26.282,59

Intereses Neto / Net Interest

1.179,347653

108.500,00

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