

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

25.08.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From 25.05.2020 (incluido) / (included)
hasta / To 25.08.2020 (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 Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

21/05/2020

-0,282%

Margen / Margin

0,150%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate

-0,132%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

0,000%*

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	7.566,88	57.099.630,72	21.216,15	2.800.531,80	21.216,15	2.206.479,60	29.619,49	2.606.515,12	100.000,00	13.200.000,00	54.347,83	5.000.000,36

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

(Euros)

0,000000 0,00 0,000000 0,00 3,144705 327,05 16,501347 1.452,12 400,711111 52.893,87 516,388926 47.507,78

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000 0,00 0,000000 0,00 0,697494 62,14 3,135256 275,90 76,135111 10.049,83 98,113896 9.026,48

Intereses Netos / Net Interest

0,000000 0,00 0,000000 0,00 2,547211 264,91 13,366091 1.176,22 324,576000 42.844,04 418,275030 38.481,30

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 0,00

Pagos no satisfechos por insuficiencia
de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient
Available Funds

(Euros)

Fecha vencimiento / Maturity date

Amortización de Principal / Principal Redemption

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

19,00%

25.11.2019 / 25.05.2020

1.478,073778 135.982,78

280,834018 25.836,74

1.197,239760 110.146,04

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Intereses por Aplazamiento de Intereses Impagados

Payments outstanding due to insufficient Available Funds
Interest Payment of deferred unpaid interest

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity Date

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

19%

25.02.2020/ 25.05.2020

13,398804 1.232,69

2,545773 234,21

10,853031 998,48

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