

BBVA RMBS 2 Fondo de Titulización de Activos (C.I.F.: V85044451)

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption

FECHA DE PAGO / Payment date

17.12.2019

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

17.09.2019 (incluido) / (included)
17.12.2019 (excluido) / (excluded)
91 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3	Bonos Serie A4	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A2 Bonds	Series A3 Bonds	Series A4 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0314148018	ES0314148026	ES0314148034	ES0314148042	ES0314148059

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

13/09/2019

-0,400%

-0,400%

-0,400%

-0,400%

-0,400%

+ Margen / Margin

0,140%

0,180%

0,200%

0,300%

0,540%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated Interest Rate

-0,260%

-0,220%

-0,200%

-0,100%

0,140%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

0,000%*

0,000%*

0,000%*

0,000%*

0,140%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	24.000		3.875		10.500		1.125		1.000	
Número de Bonos / N. Bonds										
Nominal / Face value	2.587,55	62.101.200,00	100.000,00	387.500.000,00	100.000,00	1.050.000.000,00	100.000,00	112.500.000,00	100.000,00	100.000.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

35,388889

35.388,89

Retención / Withholding tax

19%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

6,723889

6.723,89

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

28,665000

28.665,00

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

* 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 4.8 de la Nota de Valores y 3.4.6.2.1 del Módulo Adicional a la Nota de Valores 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 4.8 of the Securities Note and 3.4.6.2.1 of the Securities Note Building Block 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

info@edt-sg.com

www.edt-sg.es