

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

17.09.2021

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

17.06.2021 (incluido) / (included)
17.09.2021 (excluido) / (excluded)
92 días / days

Determinación Tipo Interés Nominal Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor
+ Margen / Margin

15/06/2021

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated Interest Rate

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

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

-0,542%	-0,542%	-0,542%	-0,542%
0,180%	0,200%	0,300%	0,540%
-0,362%	-0,342%	-0,242%	-0,002%
0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,000%*

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	3.875		10.500		1.125		1.000
34.589,47	134.034.196,25	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

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax 19%

Intereses Netos / Net Interest

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00

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

* 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.