

BBVA RMBS 12 Fondo de Titulización de Activos (CIF:V86887791)

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

24.10.2019

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

24.07.2019 (incluido) / (included)
24.10.2019 (excluido) / (excluded)
92 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B
Series A Bonds	Series B Bonds
ES0308935008	ES0308935016

Determinación Tipo Interés Nominal Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor 22/07/2019 -0,374%

+ Margen / Margin 0,300%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate -0,074%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate **0,000%***

-0,374%

0,400%

0,026%

0,026%

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series
	36.105		7.395
64.341,11	2.323.035.776,55	100.000,00	739.500.000,00

Liquidación de Intereses Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest (Euros) 0,000000

Retención / Withholding tax 19,0% 0,000000

Intereses Netos / Net Interest 0,000000

0,00 6,644444 49.135,66

0,00 1,262444 9.335,77

0,00 5,382000 39.799,89

Amortización de Principal Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros)

A determinar / To be determined 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.