

BBVA RMBS 1 Fondo de Titulización de Activos (C.I.F.: V84994144)

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

19.09.2018

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

19.06.2018 (incluido) / (included)
19.09.2018 (excluido) / (excluded)
92 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A2 Bonds	Series A3 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0314147010	ES0314147028	ES0314147036	ES0314147044

Determinación Tipo Interés Nominal Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

15/06/2018

-0,321%

-0,321%

-0,321%

-0,321%

+ Margen / Margin

0,130%

0,220%

0,300%

0,540%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated Interest Rate

-0,191%

-0,101%

-0,021%

0,219%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

0,000%*

0,000%*

0,000%*

0,219%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	14.000		4.950		1.200		850	
Número de Bonos / N. Bonds								
Nominal / Face value	24.824,56	347.543.840,00	100.000,00	495.000.000,00	100.000,00	120.000.000,00	100.000,00	85.000.000,00

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

55,966667

47.571,67

Retención / Withholding tax

19%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

10,633667

9.038,62

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

45,333000

38.533,05

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.

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