

VALENCIA HIPOTECARIO 2 Fondo de Titulización Hipotecaria

(C.I.F.: V84530526)

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

24.04.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

24.01.2020
24.04.2020
91

(incluido) / (included)
(excluido) / (excluded)
días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds
ES0382745000	ES0382745018	ES0382745026	ES0382745034

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor
Margen / Margin

22.01.2020

-0,390%
0,140%

-0,390%
0,320%

-0,390%
0,550%

-0,390%
3,500%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,250%

-0,070%

0,160%

3,110%

Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate

0,000%*

0,000%*

0,160%

3,110%

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	9.095		212		94		99
13.296,14	120.928.393,30	27.517,18	5.833.642,16	27.521,07	2.586.980,58	50.505,06	5.000.000,94

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax
Intereses Netos / Net Interest

19,00%

0,000000
0,00
0,000000

0,00
0,00
0,000000

11,130744
2,114841
9,015903

1.046,29
198,80
847,49

397,039918
75,437584
321,602334

39.306,95
7.468,32
31.838,63

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar/to be determined

A determinar/to be determined

A determinar/to be determined

* 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.