

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

24.01.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

24.10.2019
24.01.2020
92

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

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>
ES0382745000	ES0382745018	ES0382745026	ES0382745034

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor
Margen / Margin

22.10.2019

-0,404%

-0,404%

-0,404%

-0,404%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,264%

-0,084%

0,146%

3,096%

Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate

0,000%*

0,000%*

0,146%

3,096%

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
	9.095		212		94		99
13.949,86	126.873.976,70	28.870,09	6.120.459,08	28.874,18	2.714.172,92	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

0,00
0,00
0,00

10,773277
2,046923
8,726354

1.012,69
192,41
820,28

399,596035
75,923247
323,672788

39.560,01
7.516,40
32.043,61

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.