

BBVA RMBS 12 Fondo de Titulización de Activos (NIF: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

24.01.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

24.10.2016 (incluido) / (included)
24.01.2017 (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 20.10.2016

-0,313%

-0,313%

+ Margen / Margin

0,300%

0,400%

Tipo de Interés Nominal calculado / Interest Rate

-0,013%

0,087%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

0,000%*

0,087%

Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series
	36.105		7.395
Número de Bonos / N. Bonds			
Nominal / Face value	(Euros)	82.635,69	2.983.561.587,45
		100.000,00	739.500.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / **360**

Intereses Brutos / Gross Interest

0,000000

0,00

22,233333

164.415,50

Retención / Withholding tax

19,0%

0,000000

0,00

4,224333

31.238,94

Neto / Net

0,000000

0,00

18,009000

133.176,56

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

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.

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