

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

26.10.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

24.07.2020 (incluido) / (included)
26.10.2020 (excluido) / (excluded)
94 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 22/07/2020 -0,454%

+ Margen / Margin 0,300%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate -0,154%

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

0,000%*

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series
	36.105		7.395
58.254,06	2.103.262.836,30	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	0,00	0,000000	0,00
0,00	0,00	0,000000	0,00
0,00	0,00	0,000000	0,00

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.

EUROPEA DE TITULIZACIÓN, S.A., S.G.F.T

C/ Lagasca, 120 -MADRID, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67

info@edt-sg.com www.edt-sg.com