

BBVA RMBS 3 Fondo de Titulización de Activos (C.I.F.: V85172252)

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

20.08.2020

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

20.05.2020 (incluido) / (included)
20.08.2020 (excluido) / (excluded)
92 días / days

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 18.05.2020

Margen / Margin

Tipo de Interes Nominal calculado / Calculated interest rate

Tipo de Interes Nominal aplicable / Applicable interest rate

Bonos Serie A1	Bonos Serie A2	Bonos Serie A3a	Bonos Serie A3b	Bonos Serie A3c	Bonos Serie A3d	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A1 Bonds	Series A2 Bonds	Series A3a Bonds	Series A3b Bonds	Series A3c Bonds	Series A3d Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0314149008	ES0314149016	ES0314149057	ES0314149065	ES0314149073	ES0314149081	ES0314149032	ES0314149040

-0,276%	-0,276%	-0,276%	-0,276%	-0,276%	-0,276%	-0,276%	-0,276%
0,160%	0,200%	0,220%	0,220%	0,220%	0,220%	0,550%	0,850%
-0,116%	-0,076%	-0,056%	-0,056%	-0,056%	-0,056%	0,274%	0,574%
0,000%	0,000%	0,000%	0,000%	0,000%	0,000%	0,274%	0,574%

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	12.000		5.955		7.200		1.440		672		288		1.560		885
17.160,77	205.929.240,00	61.977,51	369.076.072,05	51.107,43	367.973.496,00	94.587,66	136.206.230,40	94.587,66	63.562.907,52	94.587,66	27.241.246,08	100.000,00	156.000.000,00	100.000,00	88.500.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest (Euros)

Retención / Withholding tax 19,0%

Intereses Netos / Net Interest

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	70,022222	109.234,67	146,688889	129.819,67
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	13,304222	20.754,59	27,870889	24.665,74
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	56,718000	88.480,08	118,818000	105.153,93

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros)

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient Available Funds (Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest (Euros)

Retención / Withholding tax 19,0%

Intereses Netos / Net Interest

20.08.2015 a / to 20.05.2020

1.360.586111 2.122.514,34 2.883.086111 2.551.531,21

258.511361 403.277,73 547.786361 484.790,95

1.102,074750 1.719.236,61 2.335,299750 2.066.740,26

* 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