

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

26.10.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

24.07.2020
26.10.2020
94

(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

22.07.2020

-0,454%
0,140%

-0,454%
0,320%

-0,454%
0,550%

-0,454%
3,500%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,314%

-0,134%

0,096%

3,046%

Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate

0,000%*

0,000%*

0,096%

3,046%

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
12.294,49	111.818.386,55	25.465,96	5.398.783,52	26.486,95	2.489.773,30	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

6,639395
1,261485
5,377910

624,10
118,58
505,52

401,689189
76,320946
325,368243

39,767,23
7.555,77
32.211,46

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar/to be determined

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.