

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

26.07.2022

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From 25.04.2022 (incluido) / (included)
hasta / To 26.07.2022 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
Serías A Bonds	Serías B Bonds	Serías C Bonds	Serías D Bonds
ES0382745000	ES0382745018	ES0382745026	ES0382745034

Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	21.04.2022	-0,463%	-0,463%	-0,463%	-0,463%
Margen / Margin		0,140%	0,320%	0,550%	3,500%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,323%	-0,143%	0,087%	3,037%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,087%	3,037%

	Bono Bond	Serie		Bono Bond	Serie		Bono Bond	Serie	
		Bond	Series		Bond	Series		Bond	Series
Número de Bonos / N.Bonds		9.095		212		94		99	
Nominal / Face value	(Euros)	8.577,69	78.014.090,55	20.086,55	4.258.348,60	22.072,26	2.074.792,44	50.505,06	5.000.000,94

Liquidación de Intereses Interest Payment

Base / Day count fraction	Act /	360							
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	4,907399	461,30	391,980994	38.806,12
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,932406	87,65	74,476389	7.373,16
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	3,974993	373,65	317,504605	31.432,96

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.