

BBVA RMBS 11 Fondo de Titulización de Activos (NIF:V86488368)

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

23.10.2017

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

24.07.2017 (incluido) / (included)
23.10.2017 (excluido) / (excluded)
91 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0369995008	ES0369995016	ES0369995024

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

El mayor de : / The greater of:

i) Cero / Zero

0,000%

0,000%

0,000%

ii) Euribor 3 meses / 3 Months Euribor (20.07.2017)

-0,332%

-0,332%

-0,332%

+ Margen / Margin

0,300%

0,500%

0,900%

-0,032%

0,168%

0,568%

Tipo de Interes Nominal aplicable / Interest Rate

0,000%

0,168%

0,568%

Bono	Emisión de Bonos	Bono	Emisión de Bonos	Bono	Emisión de Bonos
<i>Bond</i>	<i>Bond Issue</i>	<i>Bond</i>	<i>Bond Issue</i>	<i>Bond</i>	<i>Bond Issue</i>
	12.040		1.190		770
Número de Bonos / N.Bonds					
Nominal / Face value (Euros)	75.006,44	100.000,00	119.000.000,00	100.000,00	77.000.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross (Euros)

0,000000

42,466667

50.535,33

143,577778

110.554,89

Interés Retención / Withholding tax 19,00%

0,000000

8,068667

9.601,71

27,279778

21.005,43

Interés Neto / Net

0,000000

34,398000

40.933,62

116,298000

89.549,46

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00