

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

24.04.2017

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

23.01.2017 (incluido) / (included)
24.04.2017 (excluido) / (excluded)
91 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
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 (19.01.2017)

-0,329%

-0,329%

-0,329%

+ Margen / Margin

0,300%

0,500%

0,900%

-0,029%

0,171%

0,571%

Tipo de Interes Nominal aplicable / Interest Rate

0,000%

0,171%

0,571%

Bono	Emisión de Bonos	Bono	Emisión de Bonos	Bono	Emisión de Bonos
Bond	Bond Issue	Bond	Bond Issue	Bond	Bond Issue
	12.040		1.190		770
77.604,48	934.357.939,20	100.000,00	119.000.000,00	100.000,00	77.000.000,00

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross (Euros)

0,000000

0,00

43,225000

51.437,75

144,336111

111.138,81

Interest Retención / Withholding tax 19,00%

0,000000

0,00

8,212750

9.773,17

27,423861

21.116,37

Neto / Net

0,000000

0,00

35,012250

41.664,58

116,912250

90.022,44

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00