

BANCAJA 11 Fondo de Titulización de Activos (C.I.F.: V85164648)

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

27.01.2012

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From 27.10.2011 (incluido) / (included)
hasta / To 27.01.2012 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series A3 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0312867015	ES0312867023	ES0312867031	ES0312867049	ES0312867056	ES0312867064

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

25/10/2011

Margen / Margin

1,588% 1,588% 1,588% 1,588% 1,588% 1,588%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

0,170% 0,210% 0,450% 0,800% 3,000% 4,000%

1,758% **1,798%** **2,038%** **2,388%** **4,588%** **5,588%**

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	11.930		4.400		630		240		200		229
75.096,74	895.904.108,20	92.043,44	404.991.136,00	100.000,00	63.000.000,00	100.000,00	24.000.000,00	100.000,00	20.000.000,00	100.000,00	22.900.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross

Interest Retención / Withholding tax

19%

Neto / Net

337,384621 4.024.998,53 422,929380 1.860.889,27 520,822222 328.118,00 610,266667 146.464,00 1.172,488889 234.497,78 1.428,044444 327.022,18

64,103078 764.749,72 80,356582 353.568,96 98,956222 62.342,42 115,950667 27.828,16 222,772889 44.554,58 271,328444 62.134,21

273,281543 3.260.248,81 342,572798 1.507.320,31 421,866000 265.775,58 494,316000 118.635,84 949,716000 189.943,20 1.156,716000 264.887,97

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

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 0,00

Pagos pendientes por insuficiencia
de Fondos Disponibles

Payments outstanding due to insufficient
Available Funds

(Euros)

Fecha de vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

Interest Retención / Withholding tax

19%

Neto / Net Interest

27.01.2009 / 27.10.2011

16.583,505556 3.797.622,78

3.150,866056 721.548,33

13.432,639500 3.076.074,45