Europea de Titulización
Sociedad Gestora de Fondos de Titulización

BBVA RMBS 11 Fondo de Titulización de Activos (CIF: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* **22.01.2020**

Periodo de Interés / *Interest accrual period*
desde / *From* **22.10.2019** (incluido) / *(included)*
hasta / *To* **22.01.2020** (excluido) / *(excluded)*
plazo / *Term* 92 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 Calculation*				
El mayor de : / *The greater of:*				
i) Cero / *Zero*		0,000%	0,000%	0,000%
ii) Euribor 3 meses / 3 Months Euribor	(18/10/2019)	-0,407%	-0,407%	-0,407%
+ Margen / *Margin*		0,300%	0,500%	0,900%
		-0,107%	0,093%	0,493%
Tipo de Interes Nominal aplicable / *Applicable Interest Rate*		**0,000%**	**0,093%**	**0,493%**

		Bono	Emisión de Bonos	Bono	Emisión de Bonos	Bono	Emisión de Bonos
		Bond	*Bond Issue*	*Bond*	*Bond Issue*	*Bond*	*Bond Issue*
Número de Bonos / *N.Bonds*			**12.040**		**1.190**		**770**
Nominal / *Face value*	**(Euros)**	**62.889,12**	**757.185.004,80**	**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 Interest*	**(Euros)**	**0,000000**	0,00	**23,766667**	28.282,33	**125,988889**	97.011,44
Retención / *Withholding tax*	**19,00%**	**0,000000**	0,00	**4,515667**	5.373,64	**23,937889**	18.432,17
Intereses Netos / *Net Interest*		**0,000000**	0,00	**19,251000**	22.908,69	**102,051000**	78.579,27
Amortización de Principal *Principal Redemption*							
Amortización / *Redemption*	**(Euros)**	**A determinar /** To be determined		**0,00**	0,00	**0,00**	0,00

EUROPEA DE TITULIZACIÓN, S.A., S.G.F.T
C/ Lagasca, 120 -MADRID, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67
info@edt-sg.com ***www.edt-sg.com***