

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

22.04.2016

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

22.01.2016 (incluido) / (included)
22.04.2016 (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 (20.01.2016)

-0,144%

-0,144%

-0,144%

+ Margen / Margin

0,300%

0,500%

0,900%

0,156%

0,356%

0,756%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

0,156%

0,356%

0,756%

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
Número de Bonos / N.Bonds					
Nominal / Face value (Euros)	82.463,17	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)

32,517977 391.516,44

89,988889 107.086,78

191,100000 147.147,00

Interés Retención / Withholding tax 19,00%

6,178416 74.388,13

17,097889 20.346,49

36,309000 27.957,93

Neto / Net

26,339561 317.128,31

72,891000 86.740,29

154,791000 119.189,07

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00