

Gestión de Activos Titulizados SGFT, S.A.
HIPOCAT 11 FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS

Bonos Emisión 10 de julio de 2006

| Concepto | Serie A2 ES0345672010 | Serie A3 ES0345672028 | Serie B ES0345672036 | Serie C ES0345672044 | Serie D ES0345672051 |
|---|--------------------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 1. A partir del día 16 de abril de 2012 (Fecha de Pago) se procederá al pago de la amortización parcial de principal y de los intereses correspondientes al período comprendido entre el 16 de enero de 2012 (incluido) y el 16 de abril de 2012 (excluido), de acuerdo con el siguiente detalle por bono: | | | | | |
| * Intereses Brutos: | 165,37 | 261,46 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| * Retención Fiscal (21%): | 34,73 | 54,91 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| * Intereses Netos: | 130,64 | 206,55 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| * Amortización de Principal: | 1.008,20 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| <i>ENTIDAD PAGADORA: BANCO SANTANDER</i> | | | | | |
| 2. Importe Nominal de cada Bono después de la amortización mencionada en el apartado 1 anterior (Saldo Principal Pendiente de Pago), y porcentaje sobre el importe nominal inicial (100.000 €). | | | | | |
| | 46.570,91 | 73.617,69 | 100.000,00 | 100.000,00 | 100.000,00 |
| | 46,57% | 73,62% | 100,00% | 100,00% | 100,00% |
| 3. Principal Devengado para Amortización de los Bonos y no satisfecho por insuficiencia de fondos de acuerdo con el orden de prelación de Pagos. | | | | | |
| | 4.695,88 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 4. Tasa de Amortización Anticipada anualizada real de los Préstamos Hipotecarios Participados a 31 de marzo de 2012. | | | | | |
| | 9,98% | 9,98% | 9,98% | 9,98% | 9,98% |
| 5. Vida de los Bonos, calculada con las hipótesis de mantenimiento de la tasa de amortización anticipada real y del ejercicio de la opción de amortización anticipada cuando el importe del principal pendiente de amortizar de las Participaciones Hipotecarias y Derechos de Crédito sea inferior al 10% inicial: | | | | | |
| Vida media residual: | 5,55 años | 3,30 años | 6,20 años | 6,20 años | 7,10 años |
| Vida total residual: | 11,55 años | 5,55 años | 11,55 años | 11,55 años | 11,55 años |
| 6. Tipo de interés nominal aplicable a los Bonos para el nuevo período de Devengo de Interés, que tendrá una duración equivalente a los días efectivos transcurridos entre el 16 de abril de 2012 (incluido) y la siguiente Fecha de Pago prevista 16 de julio de 2012 (excluida) | | | | | |
| * Tipo de interés | 0,887% | 0,917% | 1,017% | 1,257% | 5,257% |
| * Intereses brutos: | 104,42 | 170,64 | 257,08 | 317,74 | 1.328,85 |
| * Retención Fiscal (21%): | 21,93 | 35,83 | 53,99 | 66,73 | 279,06 |
| * Intereses Netos: | 82,49 | 134,81 | 203,09 | 251,01 | 1.049,79 |

(Importes expresados en euros)