

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

22.07.2016

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

22.04.2016 (incluido) / (included)
22.07.2016 (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 (20.04.2016)

-0,249%

-0,249%

-0,249%

+ Margen / Margin

0,300%

0,500%

0,900%

0,051%

0,251%

0,651%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

0,051%

0,251%

0,651%

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)	81.178,34	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)

10,465241 126.001,50

63,447222 75.502,19

164,558333 126.709,92

Interés Retención / Withholding tax 19,00%

1,988396 23.940,29

12,054972 14.345,42

31,266083 24.074,88

Neto / Net

8,476845 102.061,21

51,392250 61.156,77

133,292250 102.635,04

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00