

HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos

(N.I.F.: V64478373)

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

16.10.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 17.07.2017 (incluido) / (included)
 hasta / To 16.10.2017 (excluido) / (excluded)
 plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
Series A2 Bonds	Series A3 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds
ES0345672010	ES0345672028	ES0345672036	ES0345672044	ES0345672051

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	13.07.2017	-0,331%	-0,331%	-0,331%	-0,331%	-0,331%
Margen / Margin		0,130%	0,160%	0,260%	0,500%	4,500%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,201%	-0,171%	-0,071%	0,169%	4,169%
Tipo de interés aplicable / Interest rate		0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,169%	4,169%

	Bono		Bono		Bono		Bono		Bono	
	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
Número de Bonos / N.Bonds	10.832		2.000		528		640		280	
Nominal / Face value	(Euros) 25.646,03	277.797.796,96	43.164,16	86.328.320,00	100.000,00	52.800.000,00	100.000,00	64.000.000,00	100.000,00	28.000.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction	Act /	360									
Intereses Brutos / Gross interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	42,719444	27.340,44	1.053,830556	295.072,56
Retención / Withholding tax	19%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	8,116694	5.194,68	200,227806	56.063,79
Neto / Net		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	34,602750	22.145,76	853,602750	239.008,77

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption	A determinar To be determined	A determinar To be determined	A determinar To be determined	A determinar To be determined	A determinar To be determined	A determinar To be determined	A determinar To be determined	A determinar To be determined	A determinar To be determined	A determinar To be determined
---------------------------	----------------------------------	----------------------------------	----------------------------------	----------------------------------	----------------------------------	----------------------------------	----------------------------------	----------------------------------	----------------------------------	----------------------------------

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments not made due to insufficient Available Funds

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross interest				15.10.2010-17.07.2017		15.01.2010-17.07.2017		15.01.2009-17.07.2017	
Retención / Withholding tax	19%			4.480,750000	2.365.836,00	7.032,030313	4.500.499,40	45.690,670000	12.793.387,60
Neto / Net				851,342500	449.508,84	1.336,085759	855.094,89	8.681,227300	2.430.743,64
				3.629,407500	1.916.327,16	5.695,944554	3.645.404,51	37.009,442700	10.362.643,96

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Intereses por Aplazamiento de Intereses Impagados

Payments outstanding due to insufficient Available Funds
Interest Payment of deferred unpaid interest

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross interest				15.10.2010-17.07.2017		15.01.2010-17.07.2017		15.01.2009-17.07.2017	
Retención / Withholding tax	19%			93,927462	49.593,70	236,205938	151.171,80	10.127,593929	2.835.726,30
Neto / Net				17,846218	9.422,80	44,879128	28.722,64	1.924,242846	538.788,00
				76,081244	40.170,90	191,326810	122.449,16	8.203,351083	2.296.938,30

* El Tipo de Interés Nominal aplicable se ha fijado en el 0,000% debido a que los términos del Folleto y en concreto los apartados 4.8 de la Nota de Valores y 3.4.6.1 del Módulo Adicional a la Nota de Valores no contemplan la posibilidad de un Tipo de Interés Nominal negativo que pudiera dar lugar a intereses a satisfacer por los tenedores de los Bonos a favor del Fondo.

* The applicable Nominal Interest Rate has been set at 0,000% because the terms of the Prospectus and specifically sections 4.8 of the Securities Note and 3.4.6.1 of the Securities Note Building Block do not provide for the possibility of a negative Nominal Interest Rate which might result in interest being payable by Bondholders to the Fund.

EUROPEA DE TITULIZACIÓN, S.A., S.G.F.T

C/ Lagasca, 120 -MADRID, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67 - Fax (34) 91 411 84 68

info@edt-sg.com www.edt-sg.com