

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

22.07.2015

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

22.04.2015 (incluido) / (included)
22.07.2015 (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

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 20.04.2015

0,001%

0,001%

0,001%

Margen / Margin

0,300%

0,500%

0,900%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

0,301%

0,501%

0,901%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	12.040		1.190		770
Número de Bonos / N. Bonds					
Nominal / Face value (Euros)	86.355,23	1.039.716.969,20	100.000,00	119.000.000,00	100.000,00
					77.000.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross

65,704336

791.080,21

126,641667

150.703,58

227,752778

175.369,64

Interés Retención / Withholding tax 20%

13,140867

158.216,04

25,328333

30.140,72

45,550556

35.073,93

Neto / Net

52,563469

632.864,17

101,313334

120.562,86

182,202222

140.295,71

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

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 - Fax (34) 91 411 84 68

info@edt-sg.com

www.edt-sg.com