

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

24.10.2016

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

22.07.2016 (incluido) / (included)
24.10.2016 (excluido) / (excluded)
94 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 (20.07.2016)

-0,297%

-0,297%

-0,297%

+ Margen / Margin

0,300%

0,500%

0,900%

0,003%

0,203%

0,603%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

0,003%

0,203%

0,603%

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)	79.905,60	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)

0,625927

7.536,16

53,005556

63.076,61

157,450000

121.236,50

Interés Retención / Withholding tax 19,00%

0,118926

1.431,87

10,071056

11.984,56

29,915500

23.034,94

Interés Neto / Net

0,507001

6.104,29

42,934500

51.092,05

127,534500

98.201,56

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00