

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 15 de julio de 2014 (Fecha de Pago) se procederá al pago de la amortización parcial de principal y de los intereses correspondientes al período comprendido entre el 15 de abril de 2014 (incluido) y el 15 de julio de 2014 (excluido), de acuerdo con el siguiente detalle por bono: | | | | | |
| * Intereses Brutos: | 44,62 | 80,02 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| * Retención Fiscal (21%): | 9,37 | 16,80 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| * Intereses Netos: | 35,25 | 63,22 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| * Amortización de Principal: | 1.710,45 | 2.878,81 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| <i>ENTIDAD PAGADORA: BARCLAYS</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 €). | | | | | |
| | 36.830,84 | 61.989,10 | 100.000,00 | 100.000,00 | 100.000,00 |
| | 36,83% | 61,99% | 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. | | | | | |
| | 7.165,89 | 12.060,75 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 4. Tasa de Amortización Anticipada anualizada real de los Préstamos Hipotecarios Participados a 30 de junio de 2014. | | | | | |
| | 7,87% | 7,87% | 7,87% | 7,87% | 7,87% |
| 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: | 6,75 años | 4,50 años | 7,45 años | 7,45 años | 8,40 años |
| Vida total residual: | 12,70 años | 6,75 años | 12,70 años | 12,70 años | 12,70 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 15 de julio de 2014 (incluido) y la siguiente Fecha de Pago prevista 15 de octubre de 2014 (excluida) | | | | | |
| * Tipo de interés | 0,333% | 0,363% | 0,463% | 0,703% | 4,703% |
| * Intereses brutos: | 31,34 | 57,51 | 118,32 | 179,66 | 1.201,88 |
| * Retención Fiscal (21%): | 6,58 | 12,08 | 24,85 | 37,73 | 252,39 |
| * Intereses Netos: | 24,76 | 45,43 | 93,47 | 141,93 | 949,49 |

(Importes expresados en euros)