

BBVA RMBS 11 Fondo de Titulización de Activos (CIF: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*

22.01.2019

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / *From*
hasta / *To*
plazo / *Term*

22.10.2018 (incluido) / *(included)*
22.01.2019 (excluido) / *(excluded)*
92 días / *days*

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0369995008	ES0369995016	ES0369995024

Determinación Tipo Interés Nominal *Nominal Interest Calculation*

El mayor de : / *The greater of:*

i) Cero / *Zero*

0,000%

0,000%

0,000%

ii) Euribor 3 meses / *3 Months Euribor* (18/10/2018)

-0,317%

-0,317%

-0,317%

+ Margen / *Margin*

0,300%

0,500%

0,900%

-0,017%

0,183%

0,583%

Tipo de Interés Nominal aplicable / *Applicable Interest Rate*

0,000%

0,183%

0,583%

Bono	Emisión de Bonos	Bono	Emisión de Bonos	Bono	Emisión de Bonos
<i>Bond</i>	<i>Bond Issue</i>	<i>Bond</i>	<i>Bond Issue</i>	<i>Bond</i>	<i>Bond Issue</i>
	12.040		1.190		770
Número de Bonos / <i>N.Bonds</i>					
Nominal / <i>Face value</i> (Euros)	68.350,02	822.934.240,80	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 Interest* (Euros)

0,000000

0,00

46,766667

55.652,33

148,988889

114.721,44

Retención / *Withholding tax*

19,00%

0,000000

0,00

8,885667

10.573,94

28,307889

21.797,07

Intereses Netos / *Net Interest*

0,000000

0,00

37,881000

45.078,39

120,681000

92.924,37

Amortización de Principal *Principal Redemption*

Amortización / *Redemption* (Euros)

A determinar / *To be determined*

0,00

0,00

0,00

0,00