

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

22.04.2015

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

22.01.2015 (incluido) / (included)
22.04.2015 (excluido) / (excluded)
90 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 20.01.2015

0,055%

0,055%

0,055%

Margen / Margin

0,300%

0,500%

0,900%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

0,355%

0,555%

0,955%

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)	87.537,29	1.053.948.971,60	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

77,689345

935.379,71

138,750000

165.112,50

238,750000

183.837,50

Interés Retención / Withholding tax

20%

15,537869

187.075,94

27,750000

33.022,50

47,750000

36.767,50

Interés Neto / Net

62,151476

748.303,77

111,000000

132.090,00

191,000000

147.070,00

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