

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

22.01.2015

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

22.10.2014 (incluido) / (included)
22.01.2015 (excluido) / (excluded)
92 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
Margen / Margin
Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

20.10.2014

0,081%

0,081%

0,081%

0,300%

0,500%

0,900%

0,381%

0,581%

0,981%

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)	88.912,64	1.070.508.185,60	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
Interest Retención / Withholding tax 21%
Neto / Net

86,571274	1.042.318,14	148,477778	176.688,56	250,700000	193.039,00
18,179968	218.886,81	31,180333	37.104,60	52,647000	40.538,19
68,391306	823.431,33	117,297445	139.583,96	198,053000	152.500,81

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

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