

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*

22.10.2018

Período de Interés /
Interest accrual period

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

23.07.2018 (incluido) / *(included)*
22.10.2018 (excluido) / *(excluded)*
91 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* (19/07/2018)

-0,321%

-0,321%

-0,321%

+ Margen / *Margin*

0,300%

0,500%

0,900%

-0,021%

0,179%

0,579%

Tipo de Interés Nominal aplicable / *Applicable Interest Rate*

0,000%

0,179%

0,579%

Número de Bonos / *N.Bonds*

Nominal / *Face value*

(Euros)

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
69.446,43	836.135.017,20	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)

Retención / *Withholding tax*

19,00%

Intereses Netos / *Net Interest*

0,000000

0,00

45,247222

53.844,19

146,358333

112.695,92

0,000000

0,00

8,596972

10.230,40

27,808083

21.412,22

0,000000

0,00

36,650250

43.613,79

118,550250

91.283,70

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