

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

22.10.2012

Periodo de Interés /

desde / From

13.06.2012

(incluido) / (included)

Interest accrual period

hasta / To

22.10.2012

(excluido) / (excluded)

plazo / Term

131

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 4 meses / 4 Month Euribor

0,759%

0,759%

0,759%

Margen / Margin

0,300%

0,500%

0,900%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

1,059%

1,259%

1,659%

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)				
	100.000,00	1.204.000.000,00	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

385,358333

4.639.714,33

458,136111

545.181,97

603,691667

464.842,58

Interest Retención / Withholding tax 21%

80,925250

974.340,01

96,208583

114.488,21

126,775250

97.616,94

Neto / Net

304,433083

3.665.374,32

361,927528

430.693,76

476,916417

367.225,64

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@eurotitulizacion.com www.edt-sg.com