

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

23.01.2017

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

24.10.2016 (incluido) / (included)
23.01.2017 (excluido) / (excluded)
91 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

El mayor de : / The greater of:

i) Cero / Zero

0,000%

0,000%

0,000%

ii) Euribor 3 meses / 3 Months Euribor (20.10.2016)

-0,313%

-0,313%

-0,313%

+ Margen / Margin

0,300%

0,500%

0,900%

-0,013%

0,187%

0,587%

Tipo de Interes Nominal aplicable / Interest Rate

0,000%

0,187%

0,587%

Bono	Emisión de Bonos	Bono	Emisión de Bonos	Bono	Emisión de Bonos
Bond	Bond Issue	Bond	Bond Issue	Bond	Bond Issue
	12.040		1.190		770
Número de Bonos / N.Bonds					
Nominal / Face value (Euros)	78.818,52	948.974.980,80	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 (Euros)

0,000000

0,00

47,269444

56.250,64

148,380556

114.253,03

Interés Retención / Withholding tax 19,00%

0,000000

0,00

8,981194

10.687,62

28,192306

21.708,08

Neto / Net

0,000000

0,00

38,288250

45.563,02

120,188250

92.544,95

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00