HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos (N.I.F.: V64478373)

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* **19.04.2022**

Periodo de Interés / *Interest accrual period*	desde / *From*	**17.01.2022**	(incluido) / *(included)*
	hasta / *To*	**19.04.2022**	(excluido) / *(excluded)*
	plazo / *Term*	92	días / *days*

		Bonos Serie A2		Bonos Serie B		Bonos Serie C		Bonos Serie D	
		Series A2 Bonds		*Series B Bonds*		*Series C Bonds*		*Series D Bonds*	
		ES0345672010		ES0345672036		ES0345672044		ES0345672051	
Determinación Interes Nominal *Nominal Interest Calculation*									
Euribor 3 meses / *3 Month Euribor*	13.01.2022	*-0,563%*		*-0,563%*		*-0,563%*		*-0,563%*	
Margen / *Margin*		0,130%		0,260%		0,500%		4,500%	
Tipo de interés calculado / *Calculated interest rate*		**-0,433%**		**-0,303%**		**-0,063%**		**3,937%**	
Tipo de interés Nominal aplicable / *Applicable interest rate*		**0,000%** *		**0,000%** *		**0,000%** *		**3,937%**	
		Bono *Bond*	**Serie** *Class*	**Bono** *Bond*	**Serie** *Class*	**Bono** *Bond*	**Serie** *Class*	**Bono** *Bond*	**Serie** *Class*
Número de Bonos / *N.Bonds*			**10.832**		**528**		**640**		**280**
Nominal / *Face value*	**(Euros)**	**14.095,09**	**152.678.014,88**	**100.000,00**	**52.800.000,00**	**100.000,00**	**64.000.000,00**	**100.000,00**	**28.000.000,00**
Liquidación de Intereses *Interest Payment*	**(Euros)**								
Base / *Day count fraction*	**Act / 360**								
Intereses Brutos / *Gross Interest*		**0,000000**	0,00	**0,000000**	0,00	**0,000000**	0,00	**1.006,122222**	281.714,22
Retención / *Withholding tax*	**19%**	**0,000000**	0,00	**0,000000**	0,00	**0,000000**	0,00	**191,163222**	53.525,70
Intereses Netos / *Net Interest*		**0,000000**	0,00	**0,000000**	0,00	**0,000000**	0,00	**814,959000**	228.188,52
Amortización de Principal *Principal Redemption*	**(Euros)**								
Amortización / *Redemption*		**A determinar** / *to be determined*		**A determinar** / *to be determined*		**A determinar** / *to be determined*		**A determinar** / *to be determined*	
Pagos no satisfechos por insuficiencia *de Fondos Disponibles* *Payments not made due to insufficient Available Funds*	**(Euros)**								
Fecha de Vencimiento / Maturity date				**15.10.2010-17.01.2022**		**15.01.2010-17.01.2022**		**15.01.2009-17.01.2022**	
Intereses Brutos / *Gross Interest*				**4.482,266667**	2.366.636,80	**7.554,774757**	4.835.055,84	**64.444,003333**	18.044.320,93
Retención / *Withholding tax*	**19%**			**851,630667**	449.660,99	**1.435,407203**	918.660,61	**12.244,360633**	3.428.420,97
Intereses Netos / *Net Interest*				**3.630,636000**	1.916.975,81	**6.119,367554**	3.916.395,23	**52.199,642700**	14.615.899,96
Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles Intereses por Aplazamiento de Intereses Impagados *Payments outstanding due to insufficient Available Funds Interest Payment of deferred unpaid interest*	**(Euros)**								
Fecha de Vencimiento / Maturity date				**15.10.2010-17.01.2022**		**15.01.2010-17.01.2022**		**15.01.2009-17.01.2022**	
Intereses Brutos / *Gross Interest*				**93,995417**	49.629,58	**274,217656**	175.499,30	**20.356,818568**	5.699.909,20
Retención / *Withholding tax*	**19%**			**17,859129**	9.429,62	**52,101355**	33.344,87	**3.867,795528**	1.082.982,75
Intereses Netos / *Net Interest*				**76,136288**	40.199,96	**222,116301**	142.154,43	**16.489,023041**	4.616.926,45

*** El Tipo de Interés Nominal aplicable se ha fijado en el 0,000% debido a que los términos del Folleto y en concreto los apartados 4.8 de la Nota de Valores y 3.4.6.1 del Módulo Adicional a la Nota de Valores no contemplan la posibilidad de un Tipo de Interés Nominal negativo que pudiera dar lugar a intereses a satisfacer por los tenedores de los Bonos a favor del Fondo.**

** The applicable Nominal Interest Rate has been set at 0.000% because the terms of the Prospectus and specifically sections 4.8 of the Securities Note and 3.4.6.1 of the Securities Note Building Block do not provide for the possibility of a negative Nominal Interest Rate which might result in interest being payable by Bondholders to the Fund.*

EUROPEA DE TITULIZACIÓN, S.A., S.G.F.T
C/ Jorge Juan 68, 28009 Madrid, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67
info@edt-sg.c www.edt-sg.com