

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

22.07.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

22.04.2020 (incluido) / (included)
22.07.2020 (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 Calculation

El mayor de : / The greater of:

i) Cero / Zero

0,000%

0,000%

0,000%

ii) Euribor 3 meses / 3 Months Euribor (20/04/2020)

-0,246%

-0,246%

-0,246%

+ Margen / Margin

0,300%

0,500%

0,900%

0,054%

0,254%

0,654%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

0,054%

0,254%

0,654%

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value (Euros)

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
60.287,00	725.855.480,00	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

8,229176 99.079,28

1,563543 18.825,06

6,665633 80.254,22

64,205556 76.404,61

12,199056 14.516,88

52,006500 61.887,73

165,316667 127.293,83

31,410167 24.185,83

133,906500 103.108,00

Amortización de Principal Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros)

A determinar / To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00