

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
24.01.2022
**Periodo de Interés /
Interest accrual period**

 desde / From
hasta / To
plazo / Term

22.10.2021 (incluido) / (included)
24.01.2022 (excluido) / (excluded)
94 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 (20/10/2021)	-0,547%	-0,547%	-0,547%
+ Margen / Margin	<u>0,300%</u>	<u>0,500%</u>	<u>0,900%</u>
	-0,247%	-0,047%	0,353%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

0,000%	0,000%	0,353%
---------------	---------------	---------------

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
51.973,25	625.757.930,00	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)	0,000000	0,00	0,000000	0,00	92,172222	70.972,61
Retención / Withholding tax 19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	17,512722	13.484,80
Intereses Netos / Net Interest	0,000000	0,00	0,000000	0,00	74,659500	57.487,81

**Amortización de Principal
Principal Redemption**
Amortización / Redemption (Euros) **A determinar / To be determined** 0,00 0,00 0,00 0,00