

HIOPCAT 11 Fondo de Titulación 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

15.07.2020

Período de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

15.04.2020 (incluido) / (included)
15.07.2020 (excluido) / (excluded)
91 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 Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 08.04.2020 -0,254%
Margen / Margin 0,130%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,124%
Tipo de interés Nominal aplicable / Applicable interest rate 0,000%*

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie

Liquidación de Intereses

Interest Payment (Euros)
Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax 19%
Intereses Netos / Net Interest

0,000000	0,00	1,516667	800,80	62,183333	39,797,33	1,073,294444	300,522,44
0,000000	0,00	0,288167	152,15	11,814833	7,561,49	203,925944	57,099,26
0,000000	0,00	1,228500	648,65	50,368500	32,235,84	869,368500	243,423,18

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

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax 19%

Intereses Netos / Net Interest

15.10.2010-15.04.2020	15.01.2010-15.04.2020	15.01.2009-15.04.2020
4.480,750000	7.475,980313	57.279,064444
851,342500	1.420,436259	10.883,022244
3.629,407500	6.055,544054	46.396,042200

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

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax 19%

Intereses Netos / Net Interest

15.10.2010-15.04.2020	15.01.2010-15.04.2020	15.01.2009-15.04.2020
93,927462	268,316672	16.032,818964
17,846218	50,980168	3.046,235603
76,081244	217,336504	12.986,583361

* 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.