

HIPOCAT 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

15.01.2021

Período de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

15.10.2020 (incluido) / (included)
15.01.2021 (excluido) / (excluded)
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 Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 13.10.2020 -0,508%
 Margen / Margin 0,130%
 Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,378%
 Tipo de interés Nominal aplicable / Applicable interest rate 0,000%*

-0,508%	-0,508%	-0,508%	-0,508%
0,130%	0,260%	0,500%	4,500%
-0,378%	-0,248%	-0,008%	3,992%
0,000%*	0,000%*	0,000%*	3,992%

Número de Bonos / N. Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	10.832		528		640		280
17.838,63	193.228.040,16	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
Retención / Withholding tax
Intereses Netos / Net Interest

19%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	1.020,177778	285.649,78
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	193,833778	54.273,46
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	826,344000	231.376,32

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
Intereses Netos / Net Interest

19%

	15.10.2010-15.10.2020	15.01.2010-15.10.2020	15.01.2009-15.10.2020
Intereses Brutos / Gross Interest	4.482,266667	7.554,774757	59.391,192221
Retención / Withholding tax	851,630667	1.435,407203	11.284,326521
Intereses Netos / Net Interest	3.630,636000	6.119,367554	48.106,865700

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
Intereses Netos / Net Interest

19%

	15.10.2010-15.10.2020	15.01.2010-15.10.2020	15.01.2009-15.10.2020
Intereses Brutos / Gross Interest	93,995417	274,217656	17.253,775714
Retención / Withholding tax	17,859129	52,101355	3.278,217386
Intereses Netos / Net Interest	76,136288	222,116301	13.975,558328

* 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.