

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

15.10.2020

Período de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

15.07.2020 (incluido) / (included)
15.10.2020 (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	13.07.2020	-0,435%	-0,435%	-0,435%	-0,435%
Margen / Margin		0,130%	0,260%	0,500%	4,500%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,305%	-0,175%	0,065%	4,065%
Tipo de interés Nominal aplicable / Applicable interest rate		0,000%	0,000%	0,065%	4,065%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
18.511,04	10.832	100.000,00	528	100.000,00	640	100.000,00	280
200.511.585,28		52.800.000,00		64.000.000,00		28.000.000,00	

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	16,611111	10.631,11	1.038,833333	290.873,33
Retención / Withholding tax	19%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	3,156111	2.019,91	197,378333	55.265,93
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	13,455000	8.611,20	841,455000	235.607,40

Amortización de Principal
Principal Redemption

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		15.10.2010-15.07.2020	15.01.2010-15.07.2020	15.01.2009-15.07.2020			
Intereses Brutos / Gross Interest		4.482.266667	2.366.636,80	7.538.163646	4.824.424,73	58.352,358888	16.338.660,48
Retención / Withholding tax	19%	851,630667	449.660,99	1.432,251092	916.640,70	11.086,948188	3.104.345,48
Intereses Netos / Net Interest		3.630,636000	1.916.975,81	6.105,912554	3.907.784,03	47.265,410700	13.234.315,00

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		15.10.2010-15.07.2020	15.01.2010-15.07.2020	15.01.2009-15.07.2020			
Intereses Brutos / Gross Interest		93,995417	49.629,58	272,965484	174.697,91	16.647,591964	4.661.325,75
Retención / Withholding tax	19%	17,859129	9.429,62	51,863442	33.192,60	3.163,042473	885.651,89
Intereses Netos / Net Interest		76,136288	40.199,96	221,102042	141.505,31	13.484,549491	3.775.673,86

* 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.