

# BBVA RMBS 1 Fondo de Titulización de Activos

## Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

**Análisis de morosidad:** Tasa de entrada acumulada en mora +3 meses (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos

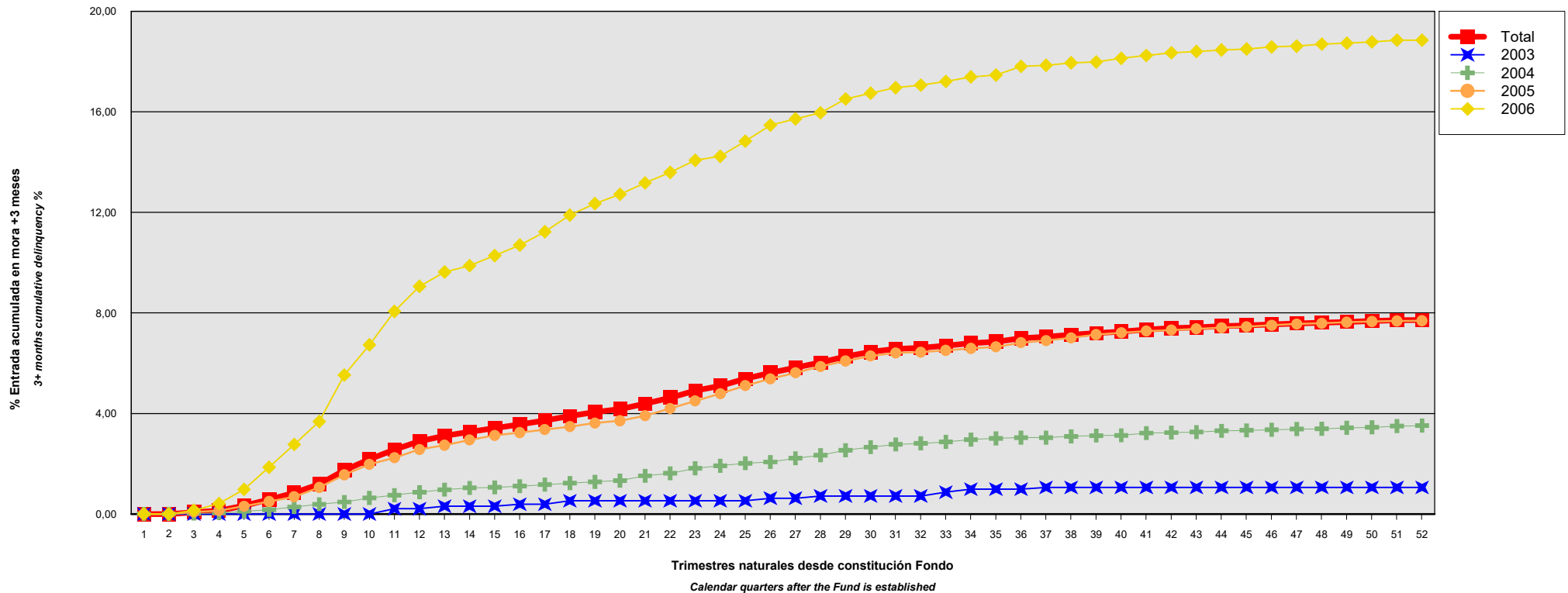
**Delinquency analysis:** 3+ months cumulative delinquency rate (calendar quarters after the Fund is established) - Detailed by asset origination years

**Activos / Assets:** Préstamos hipotecarios vivienda (CTHs) / Residential mortgage loans (PTCs)

**Fecha / Date:** 31/10/2019

**Divisa / Currency:** EUR

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros o actualización de información de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad / This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections or information update of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates



## BBVA RMBS 1 Fondo de Titulización de Activos

### Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

**Análisis de morosidad:** Tasa de entrada acumulada en mora +3 meses (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos

**Delinquency analysis:** 3+ months cumulative delinquency rate (calendar quarters after the Fund is established) - Detailed by asset origination years

**Activos / Assets:** Préstamos hipotecarios vivienda (CTHs) / Residential mortgage loans (PTCs)

**Fecha / Date:** 31/10/2019

**Divisa / Currency:** EUR

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros o actualización de información de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad / This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections or information update of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates

Originación activo Asset origination	Total	2003	2004	2005	2006
Principal titulizado (mill. €) Principal securitised (€ million)	2.500,000	148,267	776,494	1.189,586	385,653
Nº activos / Nº. of assets	15.470	1.159	5.290	6.913	2.108
1	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0
2	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0
3	0,07% 9	0,00% 0	0,02% 1	0,08% 5	0,15% 3
4	0,14% 18	0,00% 0	0,04% 2	0,14% 8	0,42% 8
5	0,33% 43	0,00% 0	0,11% 6	0,31% 18	0,98% 19
6	0,58% 74	0,00% 0	0,17% 9	0,50% 30	1,86% 35
7	0,84% 113	0,00% 0	0,28% 16	0,69% 44	2,77% 53
8	1,19% 160	0,00% 0	0,39% 21	1,06% 66	3,68% 73
9	1,74% 234	0,00% 0	0,48% 27	1,56% 97	5,53% 110
10	2,18% 293	0,00% 0	0,64% 35	1,98% 126	6,73% 132
11	2,56% 343	0,21% 2	0,75% 41	2,24% 142	8,06% 158
12	2,90% 388	0,21% 2	0,87% 46	2,57% 162	9,06% 178
13	3,11% 414	0,31% 3	0,97% 51	2,74% 172	9,63% 188
14	3,27% 438	0,31% 3	1,04% 54	2,95% 186	9,88% 195
15	3,42% 460	0,31% 3	1,06% 55	3,13% 199	10,28% 203
16	3,56% 479	0,39% 4	1,11% 57	3,24% 206	10,70% 212
17	3,72% 503	0,39% 4	1,17% 60	3,36% 215	11,23% 224
18	3,90% 531	0,53% 6	1,23% 64	3,48% 224	11,89% 237

## BBVA RMBS 1 Fondo de Titulización de Activos

### Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

**Análisis de morosidad:** Tasa de entrada acumulada en mora +3 meses (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos

**Delinquency analysis:** 3+ months cumulative delinquency rate (calendar quarters after the Fund is established) - Detailed by asset origination years

**Activos / Assets:** Préstamos hipotecarios vivienda (CTHs) / Residential mortgage loans (PTCs)

**Fecha / Date:** 31/10/2019

**Divisa / Currency:** EUR

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros o actualización de información de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad / This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections or information update of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates

	Total	2003		2004		2005		2006		
19	4,06%	556	0,53%	6	1,28%	68	3,62%	234	12,35%	248
20	4,17%	573	0,53%	6	1,33%	71	3,71%	240	12,72%	256
21	4,39%	605	0,53%	6	1,52%	80	3,91%	254	13,17%	265
22	4,63%	640	0,53%	6	1,62%	85	4,20%	275	13,59%	274
23	4,91%	686	0,53%	6	1,82%	97	4,50%	298	14,07%	285
24	5,10%	713	0,53%	6	1,92%	103	4,79%	316	14,23%	288
25	5,38%	754	0,53%	6	2,02%	109	5,11%	339	14,83%	300
26	5,62%	788	0,63%	7	2,07%	112	5,38%	356	15,47%	313
27	5,82%	818	0,63%	7	2,22%	121	5,62%	371	15,72%	319
28	6,03%	850	0,72%	8	2,34%	128	5,87%	389	15,96%	325
29	6,27%	889	0,72%	8	2,54%	139	6,09%	408	16,51%	334
30	6,45%	917	0,72%	8	2,66%	146	6,29%	424	16,74%	339
31	6,57%	938	0,72%	8	2,77%	152	6,41%	434	16,96%	344
32	6,61%	948	0,72%	8	2,81%	156	6,44%	437	17,06%	347
33	6,70%	965	0,87%	10	2,87%	162	6,51%	442	17,21%	351
34	6,80%	984	0,99%	12	2,96%	168	6,59%	449	17,39%	355
35	6,85%	994	0,99%	12	3,01%	171	6,65%	454	17,46%	357
36	6,99%	1.018	0,99%	12	3,04%	173	6,82%	468	17,81%	365
37	7,05%	1.029	1,06%	13	3,04%	174	6,90%	476	17,85%	366
38	7,13%	1.045	1,06%	13	3,09%	178	7,01%	485	17,95%	369
39	7,20%	1.060	1,06%	13	3,12%	181	7,14%	496	17,98%	370
40	7,26%	1.071	1,06%	13	3,13%	182	7,21%	502	18,13%	374
41	7,34%	1.086	1,06%	13	3,22%	187	7,28%	508	18,24%	378
42	7,39%	1.097	1,06%	13	3,24%	190	7,32%	514	18,35%	380

## BBVA RMBS 1 Fondo de Titulización de Activos

### Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

**Análisis de morosidad:** Tasa de entrada acumulada en mora +3 meses (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos

**Delinquency analysis:** 3+ months cumulative delinquency rate (calendar quarters after the Fund is established) - Detailed by asset origination years

**Activos / Assets:** Préstamos hipotecarios vivienda (CTHs) / Residential mortgage loans (PTCs)

**Fecha / Date:** 31/10/2019

**Divisa / Currency:** EUR

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros o actualización de información de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad / This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections or information update of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates

	Total	2003	2004	2005	2006
43	7,42%1.104	1,06% 13	3,26% 191	7,37% 518	18,40% 382
44	7,47%1.113	1,06% 13	3,31% 195	7,41% 521	18,46% 384
45	7,50%1.119	1,06% 13	3,33% 196	7,45% 525	18,50% 385
46	7,54%1.128	1,06% 13	3,35% 198	7,51% 530	18,58% 387
47	7,58%1.137	1,06% 13	3,38% 202	7,56% 534	18,61% 388
48	7,61%1.144	1,06% 13	3,39% 203	7,59% 538	18,69% 390
49	7,64%1.150	1,06% 13	3,43% 205	7,63% 541	18,73% 391
50	7,68%1.155	1,06% 13	3,45% 207	7,66% 543	18,78% 392
51	7,71%1.162	1,06% 13	3,50% 210	7,68% 545	18,85% 394
52	7,72%1.165	1,06% 13	3,52% 212	7,69% 546	18,85% 394