



## BBVA RMBS 5 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

Origenación activo Asset origination	Total	1990	1991	1992	1993	1994	1995	1996	1997	1998	1999	2000	2001	2002	2003	2004	2005
Principal titulizado (mill. €) Principal securitised (€ million)	5.000,001	0,292	0,064	0,000	0,408	0,619	1,231	1,447	4,905	11,790	14,686	8,486	12,493	23,061	39,885	138,589	199,750
Nº activos / Nº. of assets	28.601	1	1	0	2	5	9	13	34	69	100	47	74	127	283	1.056	1.284
1	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0
2	0,15% 44	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,46% 4	0,27% 4
3	0,70% 204	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	1,05% 12	1,06% 13
4	1,45% 415	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,92% 2	2,35% 25	2,33% 31
5	2,08% 601	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	1,34% 1	0,00% 0	1,73% 1	0,81% 1	1,31% 2	1,18% 3	3,17% 34	3,40% 45
6	2,58% 744	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	1,34% 1	0,00% 0	2,77% 2	0,81% 1	1,31% 2	1,18% 3	4,24% 44	4,18% 57
7	3,00% 872	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	1,34% 1	0,58% 1	2,77% 2	0,81% 1	1,83% 3	2,26% 7	4,66% 48	4,93% 68
8	3,37% 978	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	1,34% 1	0,58% 1	4,50% 3	0,81% 1	1,83% 3	2,82% 8	5,08% 52	5,82% 78
9	3,67% 1.071	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	1,34% 1	0,58% 1	4,50% 3	0,81% 1	2,34% 4	2,82% 8	5,49% 59	6,08% 83
10	4,05% 1.169	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	1,34% 1	0,58% 1	4,50% 3	0,81% 1	2,34% 4	2,82% 8	5,83% 62	7,00% 92
11	4,41% 1.270	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	1,34% 1	0,90% 2	4,50% 3	0,81% 1	2,34% 4	3,11% 9	6,05% 64	7,92% 102
12	4,79% 1.378	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	1,34% 1	0,90% 2	5,67% 4	0,81% 1	2,34% 4	3,34% 11	6,10% 65	8,23% 107
13	5,15% 1.480	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	1,34% 1	0,90% 2	5,67% 4	0,81% 1	2,34% 4	4,57% 13	6,24% 68	8,34% 110
14	5,47% 1.573	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	2,44% 2	0,90% 2	5,67% 4	0,81% 1	2,34% 4	5,14% 14	6,70% 73	8,91% 116
15	5,79% 1.662	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	2,44% 2	0,90% 2	5,67% 4	0,81% 1	2,34% 4	5,23% 15	6,92% 76	9,05% 120
16	6,19% 1.780	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	2,44% 2	0,90% 2	7,66% 5	2,41% 2	2,34% 4	5,70% 16	7,11% 78	9,39% 124
17	6,50% 1.872	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	2,44% 2	0,90% 2	7,66% 5	2,41% 2	2,34% 4	5,94% 17	7,55% 82	9,76% 129
18	6,89% 1.981	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	5,00% 1	2,44% 2	7,66% 5	2,41% 2	2,34% 4	5,94% 17	8,10% 88	10,06% 134

2006	2007
0,00% 0	0,00% 0
0,64% 11	0,11% 25
1,90% 38	0,60% 141
2,54% 49	1,33% 308
3,57% 71	1,90% 443
4,57% 90	2,35% 544
5,30% 105	2,72% 636
6,02% 118	3,04% 713
6,54% 128	3,32% 783
6,84% 136	3,70% 861
7,14% 143	4,05% 941
7,81% 156	4,42%1.027
8,35% 165	4,80%1.112
8,75% 173	5,09%1.184
9,08% 180	5,42%1.258
9,54% 190	5,82%1.356
9,80% 197	6,14%1.431
10,37% 209	6,51%1.515

## BBVA RMBS 5 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	1990	1991	1992	1993	1994	1995	1996	1997	1998	1999	2000	2001	2002	2003	2004	2005
19	7,22%2.074	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	5,00% 1	2,44% 2	3,14% 4	7,66% 5	3,49% 3	2,34% 4	5,94% 17	8,44% 92	10,43% 139
20	7,58%2.191	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	5,00% 1	2,90% 3	3,14% 4	7,66% 5	3,49% 3	2,34% 4	5,94% 17	8,68% 94	10,67% 142
21	7,94%2.299	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	5,00% 1	2,90% 3	3,14% 4	7,66% 5	3,49% 3	2,34% 4	6,15% 18	9,13% 98	11,03% 147
22	8,30%2.407	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	2,90% 3	3,14% 4	7,66% 5	4,75% 4	2,34% 4	6,29% 19	9,43% 103	11,38% 153
23	8,54%2.479	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	2,90% 3	3,14% 4	7,66% 5	4,75% 4	3,89% 5	6,87% 20	9,61% 105	11,49% 155
24	8,74%2.541	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	4,40% 4	3,14% 4	7,66% 5	4,75% 4	3,89% 5	6,87% 20	9,77% 107	11,73% 160
25	8,92%2.598	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	4,40% 4	3,14% 4	7,66% 5	4,75% 4	4,19% 6	7,51% 22	10,17% 110	11,74% 161
26	9,07%2.647	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	4,40% 4	3,14% 4	7,66% 5	4,75% 4	4,19% 6	7,51% 22	10,39% 111	11,82% 163
27	9,19%2.687	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	4,40% 4	4,47% 5	7,66% 5	4,75% 4	4,19% 6	7,85% 24	10,39% 111	11,93% 164
28	9,42%2.760	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	4,40% 4	4,47% 5	7,66% 5	4,75% 4	5,85% 8	7,90% 25	10,69% 114	12,12% 168
29	9,52%2.795	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	4,40% 4	4,47% 5	7,66% 5	4,75% 4	5,85% 8	7,90% 25	10,69% 114	12,12% 168
30	9,64%2.838	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	4,40% 4	4,47% 5	7,66% 5	4,75% 4	5,85% 8	8,10% 26	10,88% 117	12,22% 169
31	9,76%2.877	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	4,40% 4	4,47% 5	7,66% 5	4,75% 4	5,85% 8	8,10% 26	11,02% 121	12,32% 171
32	9,87%2.915	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	4,40% 4	4,47% 5	7,66% 5	4,75% 4	5,85% 8	8,10% 26	11,13% 123	12,48% 175
33	9,94%2.943	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	4,40% 4	4,47% 5	7,66% 5	4,75% 4	5,85% 8	8,64% 28	11,23% 124	12,59% 177
34	10,02%2.975	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	4,40% 4	4,47% 5	7,66% 5	4,75% 4	5,85% 8	8,64% 28	11,30% 125	12,65% 178
35	10,12%3.002	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	5,79% 5	4,47% 5	7,66% 5	4,75% 4	8,33% 9	8,64% 28	11,39% 126	12,65% 178
36	10,22%3.038	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	5,79% 5	4,47% 5	9,07% 6	4,75% 4	8,33% 9	8,64% 28	11,47% 127	12,70% 179
37	10,32%3.073	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	5,79% 5	4,47% 5	9,07% 6	4,75% 4	8,33% 9	8,64% 28	11,56% 129	12,75% 180
38	10,38%3.093	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	5,79% 5	4,47% 5	9,07% 6	7,19% 5	8,33% 9	8,64% 28	11,57% 130	12,75% 180
39	10,42%3.111	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	5,79% 5	4,47% 5	9,07% 6	7,19% 5	8,33% 9	8,64% 28	11,57% 130	12,75% 180
40	10,48%3.132	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	5,79% 5	4,47% 5	9,07% 6	7,19% 5	8,33% 9	8,64% 28	11,57% 130	12,75% 180
41	10,53%3.156	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	5,79% 5	4,47% 5	9,07% 6	7,99% 6	8,33% 9	8,93% 29	11,59% 131	12,75% 180
42	10,58%3.174	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	5,79% 5	4,47% 5	9,07% 6	7,99% 6	8,33% 9	8,93% 29	11,80% 134	13,08% 182

2006	2007
10,68% 214	6,85%1.592
11,38% 227	7,20%1.690
11,83% 236	7,56%1.779
12,13% 241	7,92%1.868
12,63% 250	8,15%1.925
12,70% 251	8,36%1.978
13,04% 256	8,53%2.023
13,30% 263	8,67%2.062
13,34% 264	8,81%2.097
13,61% 272	9,02%2.152
13,76% 276	9,13%2.183
13,89% 280	9,25%2.217
13,99% 282	9,37%2.248
14,12% 285	9,48%2.277
14,18% 288	9,55%2.297
14,51% 295	9,62%2.320
14,64% 298	9,70%2.341
14,79% 302	9,80%2.370
14,91% 304	9,91%2.400
15,03% 307	9,96%2.415
15,08% 309	10,00%2.431
15,25% 311	10,06%2.450
15,28% 312	10,11%2.470
15,31% 313	10,15%2.482

## BBVA RMBS 5 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	1990	1991	1992	1993	1994	1995	1996	1997	1998	1999	2000	2001	2002	2003	2004	2005
43	10,62% 3.186	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	5,79% 5	4,47% 5	9,07% 6	7,99% 6	8,33% 9	8,93% 29	11,80% 134	13,08% 182
44	10,68% 3.207	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	5,79% 5	4,47% 5	9,07% 6	7,99% 6	8,33% 9	8,93% 29	11,96% 136	13,08% 182
45	10,74% 3.233	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	5,79% 5	4,47% 5	9,07% 6	7,99% 6	8,33% 9	9,58% 30	11,97% 137	13,15% 183
46	10,81% 3.256	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	5,79% 5	4,47% 5	9,07% 6	7,99% 6	8,33% 9	9,58% 30	11,98% 138	13,23% 185
47	10,82% 3.260	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	6,08% 1	0,00% 0	7,57% 2	5,79% 5	4,47% 5	9,07% 6	7,99% 6	8,33% 9	9,58% 30	11,98% 138	13,27% 186

2006	2007
15,31% 313	10,19%2.494
15,43% 315	10,25%2.511
15,48% 317	10,31%2.532
15,48% 317	10,39%2.552
15,48% 317	10,40%2.555