

BANCAJA 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Análisis de morosidad: Tasa de entrada acumulada en mora 18 meses* (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos

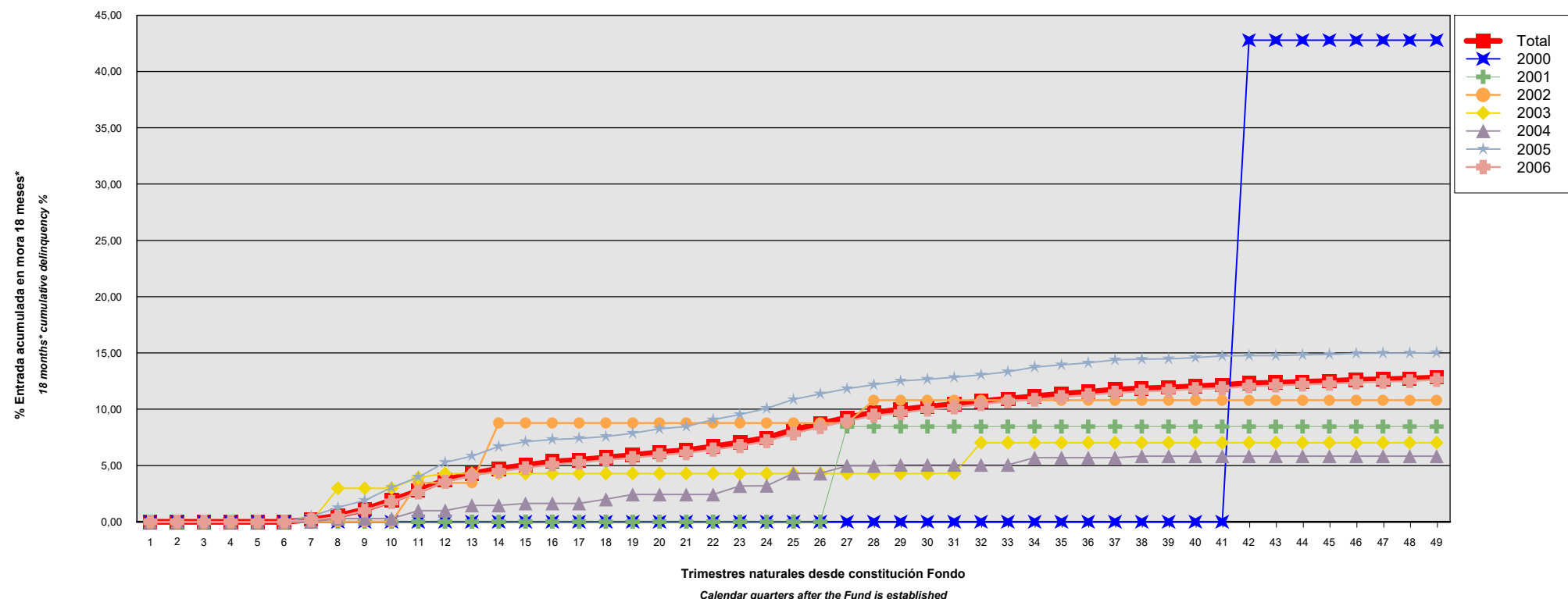
Delinquency analysis: 18 months* cumulative delinquency rate (calendar quarters after the Fund is established) - Detailed by asset origination years

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

Fecha / Date: 31/08/2019

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



*Incluye en su caso los activos titulizados clasificados como dudosos/fallidos por duda razonable sobre reembolso total. En los informes generados a partir de agosto de 2015, incluye además los activos titulizados dados de baja por adjudicación judicial o dación en pago de los inmuebles hipotecados, aunque se encontraran en mora por un periodo inferior al analizado en este informe. Para el cómputo de estos activos titulizados se contempla la fecha en la que se contabiliza la adjudicación o dación en pago del inmueble y el saldo vivo del principal inmediatamente anterior a esa fecha.

*Includes, as the case may be, securitised assets classified as doubtful/bad debts because full repayment thereof is reasonably to be doubted. In reports generated from August 2015 this moreover includes securitised assets removed following an award by the court or accepted in lieu of foreclosure of the mortgaged properties, even if they had been in arrears for a period shorter than that analysed in this report. Computation of those securitised assets takes into account both the date on which the award or acceptance in lieu of foreclosure of the property is booked and the outstanding principal balance immediately before that date.

BANCAJA 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Análisis de morosidad: Tasa de entrada acumulada en mora 18 meses* (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos

Delinquency analysis: 18 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: 31/08/2019

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	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006
Principal titulizado (mill. €) Principal securitised (€ million)	2.000,022	0,187	0,538	2,648	5,422	23,518	252,616	1.715,093
Nº activos / N°. of assets	13.162	2	5	23	47	170	1.706	11.209
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
2	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0
3	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0
4	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0
5	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0
6	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0
7	0,20% 30	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,48% 10	0,16% 20
8	0,54% 87	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	2,98% 1	0,28% 1	1,27% 26	0,43% 59
9	1,10% 169	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	2,98% 1	0,28% 1	1,90% 41	0,99% 126
10	1,91% 287	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	2,98% 1	0,28% 1	3,05% 67	1,76% 218
11	2,76% 413	0,00% 0	0,00% 0	3,47% 1	3,92% 2	1,00% 2	3,97% 87	2,60% 321
12	3,74% 550	0,00% 0	0,00% 0	3,47% 1	4,29% 3	1,00% 2	5,28% 111	3,55% 433
13	4,29% 651	0,00% 0	0,00% 0	3,47% 1	4,29% 3	1,46% 3	5,84% 123	4,10% 521
14	4,72% 711	0,00% 0	0,00% 0	8,78% 2	4,29% 3	1,46% 3	6,69% 137	4,48% 566
15	5,03% 815	0,00% 0	0,00% 0	8,78% 2	4,29% 3	1,63% 4	7,11% 156	4,77% 650
16	5,35% 942	0,00% 0	0,00% 0	8,78% 2	4,29% 3	1,64% 5	7,32% 167	5,11% 765
17	5,49% 966	0,00% 0	0,00% 0	8,78% 2	4,29% 3	1,64% 5	7,41% 168	5,26% 788
18	5,71% 1.015	0,00% 0	0,00% 0	8,78% 2	4,29% 3	2,00% 7	7,58% 175	5,49% 828

*Incluye en su caso los activos titulizados clasificados como dudosos/fallidos por duda razonable sobre reembolso total. En los informes generados a partir de agosto de 2015, incluye además los activos titulizados dados de baja por adjudicación judicial o dación en pago de los inmuebles hipotecados, aunque se encontraran en mora por un periodo inferior al analizado en este informe. Para el cómputo de estos activos titulizados se contempla la fecha en la que se contabiliza la adjudicación o dación en pago del inmueble y el saldo vivo del principal inmediatamente anterior a esa fecha.

*Includes, as the case may be, securitised assets classified as doubtful/bad debts because full repayment thereof is reasonably to be doubted. In reports generated from August 2015 this moreover includes securitised assets removed following an award by the court or accepted in lieu of foreclosure of the mortgaged properties, even if they had been in arrears for a period shorter than that analysed in this report. Computation of those securitised assets takes into account both the date on which the award or acceptance in lieu of foreclosure of the property is booked and the outstanding principal balance immediately before that date.

BANCAJA 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Análisis de morosidad: Tasa de entrada acumulada en mora 18 meses* (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos

Delinquency analysis: 18 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: 31/08/2019

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	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006
19	5,91%1.090	0,00% 0	0,00% 0	8,78% 2	4,29% 3	2,43% 8	7,87% 184	5,68% 893
20	6,18%1.135	0,00% 0	0,00% 0	8,78% 2	4,29% 3	2,43% 8	8,27% 192	5,93% 930
21	6,36%1.163	0,00% 0	0,00% 0	8,78% 2	4,29% 3	2,43% 8	8,47% 197	6,11% 953
22	6,70%1.210	0,00% 0	0,00% 0	8,78% 2	4,29% 3	2,43% 8	9,07% 205	6,41% 992
23	7,04%1.257	0,00% 0	0,00% 0	8,78% 2	4,29% 3	3,18% 11	9,53% 212	6,73%1.029
24	7,47%1.335	0,00% 0	0,00% 0	8,78% 2	4,29% 3	3,21% 12	10,08% 224	7,16%1.094
25	8,17%1.444	0,00% 0	0,00% 0	8,78% 2	4,29% 3	4,30% 13	10,86% 239	7,84%1.187
26	8,73%1.527	0,00% 0	0,00% 0	8,78% 2	4,29% 3	4,30% 14	11,36% 252	8,42%1.256
27	9,26%1.593	0,00% 0	8,46% 1	8,78% 2	4,29% 3	4,98% 15	11,82% 258	8,95%1.314
28	9,72%1.657	0,00% 0	8,46% 1	10,80% 3	4,29% 3	4,98% 15	12,17% 264	9,44%1.371
29	9,97%1.698	0,00% 0	8,46% 1	10,80% 3	4,29% 3	5,06% 16	12,51% 270	9,68%1.405
30	10,23%1.743	0,00% 0	8,46% 1	10,80% 3	4,29% 3	5,06% 16	12,66% 275	9,96%1.445
31	10,44%1.785	0,00% 0	8,46% 1	10,80% 3	4,31% 4	5,06% 16	12,83% 279	10,18%1.482
32	10,71%1.822	0,00% 0	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,06% 16	13,05% 282	10,45%1.515
33	10,94%1.856	0,00% 0	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,06% 16	13,32% 287	10,69%1.544
34	11,15%1.883	0,00% 0	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,70% 18	13,75% 293	10,85%1.563
35	11,37%1.921	0,00% 0	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,70% 18	13,94% 298	11,09%1.596
36	11,54%1.950	0,00% 0	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,70% 18	14,11% 302	11,26%1.621
37	11,76%1.993	0,00% 0	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,70% 18	14,39% 308	11,47%1.658
38	11,85%2.020	0,00% 0	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,83% 20	14,44% 309	11,57%1.682
39	11,93%2.035	0,00% 0	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,83% 20	14,48% 311	11,66%1.695
40	12,05%2.055	0,00% 0	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,83% 20	14,58% 314	11,79%1.712
41	12,15%2.071	0,00% 0	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,83% 20	14,74% 317	11,87%1.725
42	12,30%2.096	42,79% 1	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,83% 20	14,77% 318	12,04%1.748

*Incluye en su caso los activos titulizados clasificados como dudosos/fallidos por duda razonable sobre reembolso total. En los informes generados a partir de agosto de 2015, incluye además los activos titulizados dados de baja por adjudicación judicial o dación en pago de los inmuebles hipotecados, aunque se encontraran en mora por un periodo inferior al analizado en este informe. Para el cómputo de estos activos titulizados se contempla la fecha en la que se contabiliza la adjudicación o dación en pago del inmueble y el saldo vivo del principal inmediatamente anterior a esa fecha.

*Includes, as the case may be, securitised assets classified as doubtful/bad debts because full repayment thereof is reasonably to be doubted. In reports generated from August 2015 this moreover includes securitised assets removed following an award by the court or accepted in lieu of foreclosure of the mortgaged properties, even if they had been in arrears for a period shorter than that analysed in this report. Computation of those securitised assets takes into account both the date on which the award or acceptance in lieu of foreclosure of the property is booked and the outstanding principal balance immediately before that date.

BANCAJA 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Análisis de morosidad: Tasa de entrada acumulada en mora 18 meses* (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos

Delinquency analysis: 18 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: 31/08/2019

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	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006
43	12,36% 2.105	42,79% 1	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,83% 20	14,77% 318	12,11% 1.757
44	12,44% 2.121	42,79% 1	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,83% 20	14,83% 319	12,20% 1.772
45	12,51% 2.133	42,79% 1	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,83% 20	14,88% 321	12,27% 1.782
46	12,61% 2.150	42,79% 1	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,83% 20	14,96% 323	12,38% 1.797
47	12,67% 2.159	42,79% 1	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,83% 20	14,98% 324	12,44% 1.805
48	12,73% 2.166	42,79% 1	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,83% 20	14,98% 324	12,51% 1.812
49	12,82% 2.180	42,79% 1	8,46% 1	10,80% 3	7,03% 5	5,83% 20	15,03% 325	12,61% 1.825

*Incluye en su caso los activos titulizados clasificados como dudosos/fallidos por duda razonable sobre reembolso total. En los informes generados a partir de agosto de 2015, incluye además los activos titulizados dados de baja por adjudicación judicial o dación en pago de los inmuebles hipotecados, aunque se encontraran en mora por un periodo inferior al analizado en este informe. Para el cómputo de estos activos titulizados se contempla la fecha en la que se contabiliza la adjudicación o dación en pago del inmueble y el saldo vivo del principal inmediatamente anterior a esa fecha.

*Includes, as the case may be, securitised assets classified as doubtful/bad debts because full repayment thereof is reasonably to be doubted. In reports generated from August 2015 this moreover includes securitised assets removed following an award by the court or accepted in lieu of foreclosure of the mortgaged properties, even if they had been in arrears for a period shorter than that analysed in this report. Computation of those securitised assets takes into account both the date on which the award or acceptance in lieu of foreclosure of the property is booked and the outstanding principal balance immediately before that date.