

BBVA RMBS 11 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

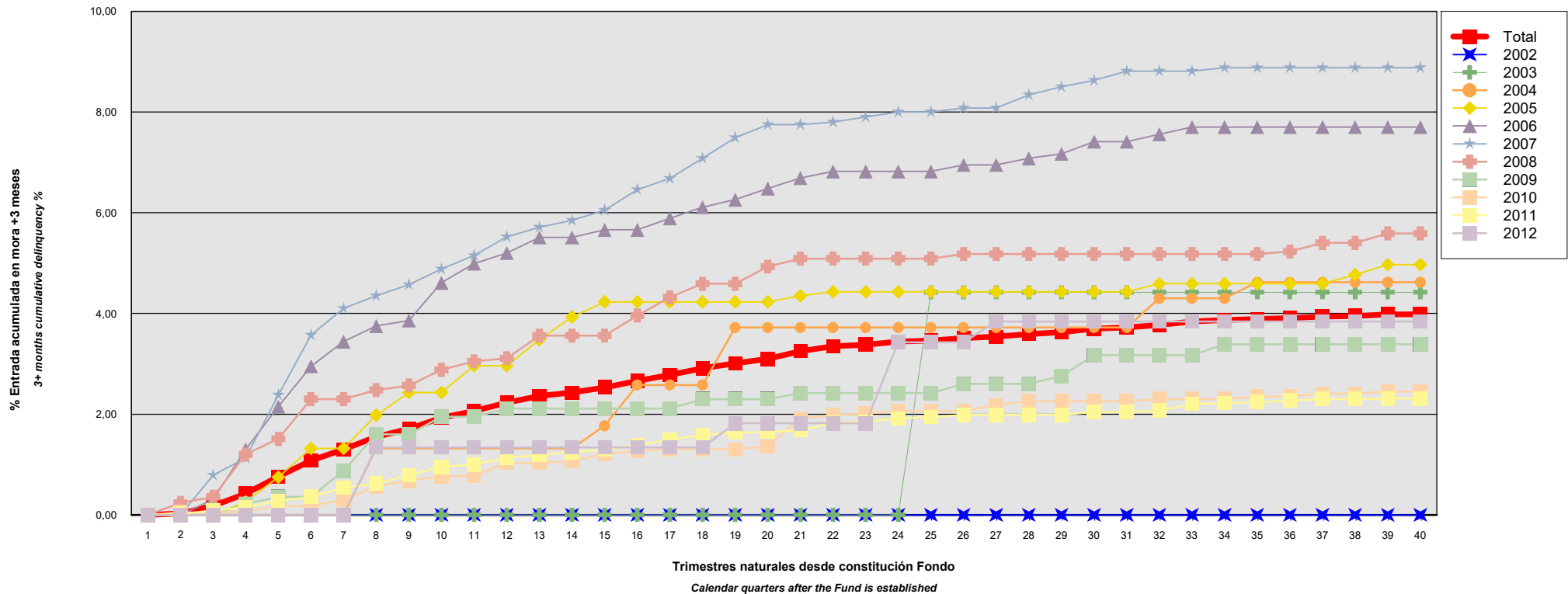
Delinquency analysis: 3+ months cumulative delinquency rate (calendar quarters after the Fund is established) - Detailed by asset origination years

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

Fecha / Date: 28/02/2022

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 11 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: 28/02/2022

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	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012
Principal titulizado (mill. €) Principal securitised (€ million)	1.400,125	0,078	2,340	16,788	67,841	128,236	153,121	90,551	65,065	261,136	603,419	11,551
Nº activos / Nº. of assets	7.958	1	15	110	386	701	749	433	335	1.391	3.753	84
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
2	0,03% 3	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,24% 1	0,00% 0	0,05% 1	0,02% 1	0,00% 0
3	0,18% 16	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,31% 2	0,79% 6	0,36% 2	0,00% 0	0,05% 1	0,09% 5	0,00% 0
4	0,42% 39	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,26% 1	1,30% 8	1,13% 11	1,20% 8	0,22% 1	0,07% 2	0,15% 8	0,00% 0
5	0,76% 70	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,75% 3	2,15% 15	2,38% 22	1,51% 10	0,36% 2	0,18% 5	0,28% 13	0,00% 0
6	1,08% 92	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	1,32% 4	2,95% 20	3,57% 30	2,30% 14	0,36% 2	0,18% 5	0,36% 17	0,00% 0
7	1,30% 112	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	1,32% 4	3,44% 23	4,10% 34	2,30% 14	0,88% 4	0,30% 8	0,54% 25	0,00% 0
8	1,55% 132	0,00% 0	0,00% 0	1,32% 1	1,98% 6	3,75% 25	4,35% 36	2,48% 15	1,60% 6	0,57% 13	0,62% 29	1,34% 1
9	1,71% 147	0,00% 0	0,00% 0	1,32% 1	2,43% 8	3,86% 26	4,57% 38	2,57% 16	1,60% 6	0,68% 16	0,79% 35	1,34% 1
10	1,93% 164	0,00% 0	0,00% 0	1,32% 1	2,43% 8	4,61% 30	4,88% 41	2,88% 18	1,95% 7	0,76% 18	0,95% 40	1,34% 1
11	2,06% 175	0,00% 0	0,00% 0	1,32% 1	2,96% 10	4,99% 33	5,15% 43	3,05% 19	1,95% 7	0,78% 19	1,00% 42	1,34% 1
12	2,23% 188	0,00% 0	0,00% 0	1,32% 1	2,96% 10	5,20% 34	5,52% 45	3,11% 20	2,11% 8	1,03% 22	1,14% 47	1,34% 1
13	2,36% 199	0,00% 0	0,00% 0	1,32% 1	3,48% 12	5,51% 36	5,71% 46	3,56% 22	2,11% 8	1,03% 22	1,19% 51	1,34% 1
14	2,43% 207	0,00% 0	0,00% 0	1,32% 1	3,93% 14	5,51% 36	5,85% 48	3,56% 22	2,11% 8	1,07% 23	1,25% 54	1,34% 1
15	2,53% 216	0,00% 0	0,00% 0	1,77% 2	4,23% 15	5,66% 37	6,05% 50	3,56% 22	2,11% 8	1,21% 25	1,29% 56	1,34% 1
16	2,66% 228	0,00% 0	0,00% 0	2,58% 3	4,23% 15	5,66% 37	6,46% 53	3,96% 24	2,11% 8	1,27% 27	1,39% 60	1,34% 1
17	2,78% 239	0,00% 0	0,00% 0	2,58% 3	4,23% 15	5,89% 39	6,68% 54	4,32% 26	2,11% 8	1,30% 28	1,49% 65	1,34% 1
18	2,91% 253	0,00% 0	0,00% 0	2,58% 3	4,23% 15	6,11% 41	7,08% 58	4,59% 28	2,30% 9	1,30% 28	1,59% 70	1,34% 1

BBVA RMBS 11 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: 28/02/2022

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	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012
19	3,01% 262	0,00% 0	0,00% 0	3,72% 4	4,23% 15	6,26% 42	7,49% 62	4,59% 28	2,30% 9	1,30% 28	1,63% 72	1,82% 2
20	3,10% 271	0,00% 0	0,00% 0	3,72% 4	4,23% 15	6,48% 44	7,75% 64	4,93% 30	2,30% 9	1,36% 29	1,65% 74	1,82% 2
21	3,25% 278	0,00% 0	0,00% 0	3,72% 4	4,35% 16	6,69% 46	7,75% 64	5,09% 31	2,42% 10	1,92% 30	1,68% 75	1,82% 2
22	3,35% 288	0,00% 0	0,00% 0	3,72% 4	4,43% 17	6,82% 47	7,80% 65	5,09% 31	2,42% 10	1,98% 31	1,83% 81	1,82% 2
23	3,38% 291	0,00% 0	0,00% 0	3,72% 4	4,43% 17	6,82% 47	7,90% 66	5,09% 31	2,42% 10	2,02% 32	1,85% 82	1,82% 2
24	3,44% 298	0,00% 0	0,00% 0	3,72% 4	4,43% 17	6,82% 47	8,00% 67	5,09% 31	2,42% 10	2,06% 33	1,92% 86	3,43% 3
25	3,46% 300	0,00% 0	4,42% 1	3,72% 4	4,43% 17	6,82% 47	8,00% 67	5,09% 31	2,42% 10	2,06% 33	1,94% 87	3,43% 3
26	3,51% 309	0,00% 0	4,42% 1	3,72% 4	4,43% 17	6,95% 49	8,08% 68	5,18% 32	2,60% 11	2,06% 33	1,99% 91	3,43% 3
27	3,54% 312	0,00% 0	4,42% 1	3,72% 4	4,43% 17	6,95% 49	8,08% 68	5,18% 32	2,60% 11	2,18% 35	1,99% 91	3,84% 4
28	3,59% 317	0,00% 0	4,42% 1	3,72% 4	4,43% 17	7,08% 50	8,34% 70	5,18% 32	2,60% 11	2,26% 37	1,99% 91	3,84% 4
29	3,63% 322	0,00% 0	4,42% 1	3,72% 4	4,43% 17	7,17% 52	8,50% 72	5,18% 32	2,76% 12	2,26% 37	1,99% 91	3,84% 4
30	3,70% 329	0,00% 0	4,42% 1	3,72% 4	4,43% 17	7,41% 54	8,63% 73	5,18% 32	3,17% 13	2,26% 37	2,04% 94	3,84% 4
31	3,72% 331	0,00% 0	4,42% 1	3,72% 4	4,43% 17	7,41% 54	8,81% 75	5,18% 32	3,17% 13	2,26% 37	2,04% 94	3,84% 4
32	3,77% 337	0,00% 0	4,42% 1	4,30% 5	4,59% 18	7,56% 55	8,81% 75	5,18% 32	3,17% 13	2,30% 38	2,07% 96	3,84% 4
33	3,84% 344	0,00% 0	4,42% 1	4,30% 5	4,59% 18	7,70% 56	8,81% 75	5,18% 32	3,17% 13	2,30% 38	2,20% 102	3,84% 4
34	3,87% 348	0,00% 0	4,42% 1	4,30% 5	4,59% 18	7,70% 56	8,88% 76	5,18% 32	3,39% 14	2,30% 38	2,22% 104	3,84% 4
35	3,89% 352	0,00% 0	4,42% 1	4,62% 6	4,59% 18	7,70% 56	8,88% 76	5,18% 32	3,39% 14	2,35% 39	2,24% 106	3,84% 4
36	3,91% 354	0,00% 0	4,42% 1	4,62% 6	4,59% 18	7,70% 56	8,88% 76	5,23% 33	3,39% 14	2,35% 39	2,27% 107	3,84% 4
37	3,94% 357	0,00% 0	4,42% 1	4,62% 6	4,59% 18	7,70% 56	8,88% 76	5,40% 34	3,39% 14	2,41% 40	2,30% 108	3,84% 4
38	3,95% 358	0,00% 0	4,42% 1	4,62% 6	4,77% 19	7,70% 56	8,88% 76	5,40% 34	3,39% 14	2,41% 40	2,30% 108	3,84% 4
39	3,98% 362	0,00% 0	4,42% 1	4,62% 6	4,97% 20	7,70% 56	8,88% 76	5,59% 35	3,39% 14	2,45% 41	2,31% 109	3,84% 4
40	3,98% 362	0,00% 0	4,42% 1	4,62% 6	4,97% 20	7,70% 56	8,88% 76	5,59% 35	3,39% 14	2,45% 41	2,31% 109	3,84% 4