

BBVA RMBS 21 Fondo de Titulización

Cartera de activos titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Intervalos de Principal / Distribution by Principal Intervals

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

Fecha / Date: 30/06/2024

Divisa / Currency: EUR

| Intervalos de Principal Principal Intervals | Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance | | | | Principal Vencido Impagado Overdue Principal | | | | Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal | | | |
|--|--|--------|------------------|----------------|---|---------|------------------|---------|--|---------|------------------|--------|
| | Num. | % | Importe / Amount | % | Num. | % | Importe / Amount | % | Num. | % | Importe / Amount | % |
| 0,00 | 11.999,99 | | | | 54 | 1,12 % | 40.217,27 | 0,80 % | 1.829 | 1,83 % | 13.403.058,12 | 0,14 % |
| 12.000,00 | 23.999,99 | 4.152 | 4,15 % | 76.317.862,19 | 137 | 2,84 % | 50.496,60 | 1,00 % | 4.152 | 4,15 % | 76.267.365,59 | 0,81 % |
| 24.000,00 | 35.999,99 | 5.622 | 5,62 % | 170.323.933,60 | 203 | 4,21 % | 152.294,59 | 3,01 % | 5.619 | 5,62 % | 170.171.639,01 | 1,81 % |
| 36.000,00 | 47.999,99 | 7.577 | 7,57 % | 319.960.532,16 | 308 | 6,39 % | 180.941,91 | 3,58 % | 7.575 | 7,57 % | 319.779.590,25 | 3,40 % |
| 48.000,00 | 59.999,99 | 9.066 | 9,06 % | 490.570.037,55 | 404 | 8,38 % | 183.998,14 | 3,64 % | 9.065 | 9,06 % | 490.386.039,41 | 5,22 % |
| 60.000,00 | 71.999,99 | 9.919 | 9,91 % | 654.959.935,44 | 451 | 9,35 % | 370.001,01 | 7,32 % | 9.916 | 9,91 % | 654.589.934,43 | 6,96 % |
| 72.000,00 | 83.999,99 | 10.368 | 10,36 % | 808.791.672,64 | 484 | 10,04 % | 366.872,29 | 7,26 % | 10.366 | 10,36 % | 808.424.800,35 | 8,60 % |
| 84.000,00 | 95.999,99 | 9.921 | 9,92 % | 892.014.822,31 | 468 | 9,71 % | 202.697,14 | 4,01 % | 9.921 | 9,92 % | 891.812.125,17 | 9,48 % |
| 96.000,00 | 107.999,99 | 8.693 | 8,69 % | 885.689.207,51 | 425 | 8,82 % | 475.915,83 | 9,41 % | 8.690 | 8,69 % | 885.213.291,68 | 9,41 % |
| 108.000,00 | 119.999,99 | 7.358 | 7,35 % | 837.246.020,94 | 399 | 8,28 % | 390.114,70 | 7,72 % | 7.356 | 7,36 % | 836.855.906,24 | 8,90 % |
| 120.000,00 | 131.999,99 | 5.992 | 5,99 % | 753.475.748,61 | 366 | 7,59 % | 688.934,46 | 13,63 % | 5.988 | 5,99 % | 752.786.814,15 | 8,01 % |
| 132.000,00 | 143.999,99 | 4.755 | 4,75 % | 654.801.377,53 | 256 | 5,31 % | 288.011,28 | 5,70 % | 4.754 | 4,75 % | 654.513.366,25 | 6,96 % |
| 144.000,00 | 155.999,99 | 3.531 | 3,53 % | 528.411.084,00 | 195 | 4,04 % | 269.541,85 | 5,33 % | 3.530 | 3,53 % | 528.141.542,15 | 5,62 % |
| 156.000,00 | 167.999,99 | 2.738 | 2,74 % | 442.775.181,47 | 179 | 3,71 % | 110.893,30 | 2,19 % | 2.738 | 2,74 % | 442.664.288,17 | 4,71 % |
| 168.000,00 | 179.999,99 | 2.033 | 2,03 % | 353.070.569,62 | 133 | 2,76 % | 89.340,61 | 1,77 % | 2.033 | 2,03 % | 352.981.229,01 | 3,75 % |
| 180.000,00 | 191.999,99 | 1.505 | 1,50 % | 279.448.871,50 | 79 | 1,64 % | 266.630,81 | 5,27 % | 1.504 | 1,50 % | 279.182.240,69 | 2,97 % |
| 192.000,00 | 203.999,99 | 1.119 | 1,12 % | 221.241.944,70 | 78 | 1,62 % | 247.389,18 | 4,89 % | 1.118 | 1,12 % | 220.994.555,52 | 2,35 % |
| 204.000,00 | 215.999,99 | 863 | 0,86 % | 181.063.829,60 | 54 | 1,12 % | 245.192,53 | 4,85 % | 862 | 0,86 % | 180.818.637,07 | 1,92 % |
| 216.000,00 | 227.999,99 | 630 | 0,63 % | 139.701.995,80 | 32 | 0,66 % | 29.226,59 | 0,58 % | 630 | 0,63 % | 139.672.769,21 | 1,49 % |
| 228.000,00 | 239.999,99 | 491 | 0,49 % | 114.857.196,65 | 22 | 0,46 % | 16.508,56 | 0,33 % | 491 | 0,49 % | 114.840.688,09 | 1,22 % |
| 240.000,00 | 251.999,99 | 353 | 0,35 % | 86.752.185,63 | 18 | 0,37 % | 250.973,12 | 4,96 % | 352 | 0,35 % | 86.501.212,51 | 0,92 % |
| 252.000,00 | 263.999,99 | 299 | 0,30 % | 77.123.347,15 | 17 | 0,35 % | 34.212,01 | 0,68 % | 299 | 0,30 % | 77.089.135,14 | 0,82 % |
| 264.000,00 | 275.999,99 | 205 | 0,20 % | 55.419.828,60 | 13 | 0,27 % | 25.560,03 | 0,51 % | 205 | 0,20 % | 55.394.268,57 | 0,59 % |
| 276.000,00 | 287.999,99 | 160 | 0,16 % | 45.097.068,62 | 7 | 0,15 % | 3.382,34 | 0,07 % | 160 | 0,16 % | 45.093.686,28 | 0,48 % |
| 288.000,00 | 299.999,99 | 143 | 0,14 % | 41.993.088,99 | 6 | 0,12 % | 16.235,59 | 0,32 % | 143 | 0,14 % | 41.976.853,40 | 0,45 % |
| 300.000,00 | 311.999,99 | 106 | 0,11 % | 32.433.212,92 | 6 | 0,12 % | 6.730,17 | 0,13 % | 106 | 0,11 % | 32.426.482,75 | 0,34 % |
| 312.000,00 | 323.999,99 | 83 | 0,08 % | 26.347.938,73 | 5 | 0,10 % | 4.729,09 | 0,09 % | 83 | 0,08 % | 26.343.209,64 | 0,28 % |
| 324.000,00 | 335.999,99 | 69 | 0,07 % | 22.756.212,59 | 4 | 0,08 % | 9.512,40 | 0,19 % | 69 | 0,07 % | 22.746.700,19 | 0,24 % |
| 336.000,00 | 347.999,99 | 59 | 0,06 % | 20.198.044,59 | 7 | 0,15 % | 19.524,51 | 0,39 % | 59 | 0,06 % | 20.178.520,08 | 0,21 % |
| 348.000,00 | 359.999,99 | 51 | 0,05 % | 18.054.303,20 | 1 | 0,02 % | 7.146,13 | 0,14 % | 51 | 0,05 % | 18.047.157,07 | 0,19 % |
| 360.000,00 | 371.999,99 | 47 | 0,05 % | 17.180.692,70 | 2 | 0,04 % | 2.671,82 | 0,05 % | 47 | 0,05 % | 17.178.020,88 | 0,18 % |
| 372.000,00 | 383.999,99 | 35 | 0,03 % | 13.225.998,99 | 2 | 0,04 % | 1.096,93 | 0,02 % | 35 | 0,03 % | 13.224.902,06 | 0,14 % |
| 384.000,00 | 395.999,99 | 29 | 0,03 % | 11.292.267,91 | 1 | 0,02 % | 2.090,21 | 0,04 % | 29 | 0,03 % | 11.290.177,70 | 0,12 % |
| 396.000,00 | 407.999,99 | 26 | 0,03 % | 10.425.645,12 | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 26 | 0,03 % | 10.425.645,12 | 0,11 % |

BBVA RMBS 21 Fondo de Titulización

Cartera de activos titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Intervalos de Principal / Distribution by Principal Intervals

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

Fecha / Date: 30/06/2024

Divisa / Currency: EUR

| Intervalos de Principal Principal Intervals | Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance | | | | Principal Vencido Impagado Overdue Principal | | | | Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal | | | | |
|--|--|----|------------------|---------------|---|---|------------------|----------|--|----|------------------|---------------|--------|
| | Num. | % | Importe / Amount | % | Num. | % | Importe / Amount | % | Num. | % | Importe / Amount | % | |
| 408.000,00 | 419.999,99 | 20 | 0,02 % | 8.284.170,55 | 0,09 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 20 | 0,02 % | 8.284.170,55 | 0,09 % |
| 420.000,00 | 431.999,99 | 18 | 0,02 % | 7.647.507,15 | 0,08 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 18 | 0,02 % | 7.647.507,15 | 0,08 % |
| 432.000,00 | 443.999,99 | 25 | 0,02 % | 10.966.423,20 | 0,12 % | 1 | 0,02 % | 1.039,77 | 0,02 % | 25 | 0,02 % | 10.965.383,43 | 0,12 % |
| 444.000,00 | 455.999,99 | 17 | 0,02 % | 7.642.721,45 | 0,08 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 17 | 0,02 % | 7.642.721,45 | 0,08 % |
| 456.000,00 | 467.999,99 | 17 | 0,02 % | 7.830.062,99 | 0,08 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 17 | 0,02 % | 7.830.062,99 | 0,08 % |
| 468.000,00 | 479.999,99 | 12 | 0,01 % | 5.701.779,24 | 0,06 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 12 | 0,01 % | 5.701.779,24 | 0,06 % |
| 480.000,00 | 491.999,99 | 9 | 0,01 % | 4.373.705,62 | 0,05 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 9 | 0,01 % | 4.373.705,62 | 0,05 % |
| 492.000,00 | 503.999,99 | 9 | 0,01 % | 4.474.541,13 | 0,05 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 9 | 0,01 % | 4.474.541,13 | 0,05 % |
| 504.000,00 | 515.999,99 | 10 | 0,01 % | 5.106.817,31 | 0,05 % | 1 | 0,02 % | 807,26 | 0,02 % | 10 | 0,01 % | 5.106.010,05 | 0,05 % |
| 516.000,00 | 527.999,99 | 6 | 0,01 % | 3.141.979,87 | 0,03 % | 1 | 0,02 % | 531,35 | 0,01 % | 6 | 0,01 % | 3.141.448,52 | 0,03 % |
| 528.000,00 | 539.999,99 | 3 | 0,00 % | 1.615.113,59 | 0,02 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 3 | 0,00 % | 1.615.113,59 | 0,02 % |
| 540.000,00 | 551.999,99 | 10 | 0,01 % | 5.482.019,38 | 0,06 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 10 | 0,01 % | 5.482.019,38 | 0,06 % |
| 552.000,00 | 563.999,99 | 5 | 0,00 % | 2.790.143,71 | 0,03 % | 1 | 0,02 % | 855,48 | 0,02 % | 5 | 0,00 % | 2.789.288,23 | 0,03 % |
| 564.000,00 | 575.999,99 | 2 | 0,00 % | 1.136.521,13 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 2 | 0,00 % | 1.136.521,13 | 0,01 % |
| 576.000,00 | 587.999,99 | 4 | 0,00 % | 2.326.736,70 | 0,02 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 4 | 0,00 % | 2.326.736,70 | 0,02 % |
| 588.000,00 | 599.999,99 | 10 | 0,01 % | 5.933.910,47 | 0,06 % | 1 | 0,02 % | 3.074,05 | 0,06 % | 10 | 0,01 % | 5.930.836,42 | 0,06 % |
| 600.000,00 | 611.999,99 | 2 | 0,00 % | 1.218.747,25 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 2 | 0,00 % | 1.218.747,25 | 0,01 % |
| 612.000,00 | 623.999,99 | 4 | 0,00 % | 2.474.691,44 | 0,03 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 4 | 0,00 % | 2.474.691,44 | 0,03 % |
| 624.000,00 | 635.999,99 | 2 | 0,00 % | 1.263.468,31 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 2 | 0,00 % | 1.263.468,31 | 0,01 % |
| 648.000,00 | 659.999,99 | 2 | 0,00 % | 1.304.918,88 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 2 | 0,00 % | 1.304.918,88 | 0,01 % |
| 660.000,00 | 671.999,99 | 2 | 0,00 % | 1.326.380,47 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 2 | 0,00 % | 1.326.380,47 | 0,01 % |
| 672.000,00 | 683.999,99 | 4 | 0,00 % | 2.710.851,11 | 0,03 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 4 | 0,00 % | 2.710.851,11 | 0,03 % |
| 684.000,00 | 695.999,99 | 1 | 0,00 % | 695.600,87 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 1 | 0,00 % | 695.600,87 | 0,01 % |
| 696.000,00 | 707.999,99 | 1 | 0,00 % | 702.697,76 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 1 | 0,00 % | 702.697,76 | 0,01 % |
| 720.000,00 | 731.999,99 | 3 | 0,00 % | 2.176.066,43 | 0,02 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 3 | 0,00 % | 2.176.066,43 | 0,02 % |
| 744.000,00 | 755.999,99 | 1 | 0,00 % | 750.986,48 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 1 | 0,00 % | 750.986,48 | 0,01 % |
| 768.000,00 | 779.999,99 | 1 | 0,00 % | 774.192,34 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 1 | 0,00 % | 774.192,34 | 0,01 % |
| 780.000,00 | 791.999,99 | 1 | 0,00 % | 786.497,60 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 1 | 0,00 % | 786.497,60 | 0,01 % |
| 792.000,00 | 803.999,99 | 1 | 0,00 % | 793.349,65 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 1 | 0,00 % | 793.349,65 | 0,01 % |
| 828.000,00 | 839.999,99 | 1 | 0,00 % | 828.983,89 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 1 | 0,00 % | 828.983,89 | 0,01 % |
| 852.000,00 | 863.999,99 | 1 | 0,00 % | 859.617,66 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 1 | 0,00 % | 859.617,66 | 0,01 % |
| 876.000,00 | 887.999,99 | 1 | 0,00 % | 886.558,52 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 1 | 0,00 % | 886.558,52 | 0,01 % |
| 888.000,00 | 899.999,99 | 1 | 0,00 % | 894.202,89 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 1 | 0,00 % | 894.202,89 | 0,01 % |
| 924.000,00 | 935.999,99 | 1 | 0,00 % | 929.580,15 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 1 | 0,00 % | 929.580,15 | 0,01 % |

BBVA RMBS 21 Fondo de Titulización

Cartera de activos titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Intervalos de Principal / Distribution by Principal Intervals

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

Fecha / Date: 30/06/2024

Divisa / Currency: EUR

| Intervalos de Principal Principal Intervals | Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance | | | | Principal Vencido Impagado Overdue Principal | | | | Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal | | | | |
|--|--|----------------|------------------|-------------------------|---|--------------|------------------|---------------------|--|----------------|------------------|-------------------------|---------------|
| | Num. | % | Importe / Amount | % | Num. | % | Importe / Amount | % | Num. | % | Importe / Amount | % | |
| 960.000,00 | 971.999,99 | 1 | 0,00 % | 965.775,03 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 1 | 0,00 % | 965.775,03 | 0,01 % |
| 996.000,00 | 1.007.999,99 | 1 | 0,00 % | 1.005.544,46 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 1 | 0,00 % | 1.005.544,46 | 0,01 % |
| 1.008.000,00 | 1.019.999,99 | 1 | 0,00 % | 1.019.053,21 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 1 | 0,00 % | 1.019.053,21 | 0,01 % |
| 1.296.000,00 | 1.307.999,99 | 1 | 0,00 % | 1.303.948,54 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 1 | 0,00 % | 1.303.948,54 | 0,01 % |
| 1.320.000,00 | 1.331.999,99 | 1 | 0,00 % | 1.329.850,55 | 0,01 % | 0 | 0,00 % | 0,00 | 0,00 % | 1 | 0,00 % | 1.329.850,55 | 0,01 % |
| Total : | | 100.041 | 100,00 | 9.407.920.651,93 | 100,00 | 4.821 | 100,00 | 5.055.390,91 | 100,00 | 100.013 | 100,00 | 9.402.865.261,02 | 100,00 |
| Media simple / Average : | | | | 94.040,65 | | | | 1.048,62 | | | | 94.016,43 | |
| Mínimo / Minimum : | | | | 24,73 | | | | 5,04 | | | | 24,73 | |
| Máximo / Maximum : | | | | 1.329.850,55 | | | | 242.602,66 | | | | 1.329.850,55 | |