

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: 31/07/2024

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				1.897	1,91 %	13.843.872,27	0,15 %	40	1,01 %	33.183,71	0,68 %	1.894	1,91 %	13.810.688,56	0,15 %
12.000,00	23.999,99				4.171	4,20 %	76.740.818,70	0,82 %	122	3,07 %	62.400,93	1,28 %	4.170	4,20 %	76.678.417,77	0,82 %
24.000,00	35.999,99				5.624	5,66 %	170.353.168,03	1,83 %	179	4,51 %	147.753,43	3,04 %	5.621	5,66 %	170.205.414,60	1,83 %
36.000,00	47.999,99				7.578	7,63 %	319.833.285,26	3,44 %	257	6,47 %	161.284,59	3,32 %	7.576	7,63 %	319.672.000,67	3,44 %
48.000,00	59.999,99				9.057	9,12 %	490.231.936,72	5,27 %	312	7,85 %	164.680,03	3,39 %	9.056	9,12 %	490.067.256,69	5,27 %
60.000,00	71.999,99				9.862	9,93 %	651.211.249,79	7,00 %	378	9,51 %	358.524,13	7,37 %	9.859	9,93 %	650.852.725,66	7,00 %
72.000,00	83.999,99				10.333	10,40 %	805.939.079,26	8,66 %	406	10,22 %	350.800,95	7,22 %	10.331	10,40 %	805.588.278,31	8,66 %
84.000,00	95.999,99				9.819	9,88 %	882.725.409,56	9,49 %	410	10,32 %	188.589,77	3,88 %	9.819	9,89 %	882.536.819,79	9,49 %
96.000,00	107.999,99				8.614	8,67 %	877.556.853,22	9,43 %	367	9,24 %	465.799,91	9,58 %	8.611	8,67 %	877.091.053,31	9,43 %
108.000,00	119.999,99				7.290	7,34 %	829.521.947,76	8,92 %	349	8,78 %	503.771,93	10,36 %	7.287	7,34 %	829.018.175,83	8,91 %
120.000,00	131.999,99				5.889	5,93 %	740.454.688,18	7,96 %	263	6,62 %	547.342,99	11,26 %	5.886	5,93 %	739.907.345,19	7,96 %
132.000,00	143.999,99				4.692	4,72 %	646.045.056,32	6,94 %	195	4,91 %	268.795,37	5,53 %	4.691	4,72 %	645.776.260,95	6,94 %
144.000,00	155.999,99				3.471	3,49 %	519.458.857,16	5,58 %	163	4,10 %	261.730,14	5,38 %	3.470	3,49 %	519.197.127,02	5,58 %
156.000,00	167.999,99				2.694	2,71 %	435.589.255,07	4,68 %	132	3,32 %	97.203,15	2,00 %	2.694	2,71 %	435.492.051,92	4,68 %
168.000,00	179.999,99				2.002	2,01 %	347.623.286,26	3,74 %	107	2,69 %	83.565,64	1,72 %	2.002	2,02 %	347.539.720,62	3,74 %
180.000,00	191.999,99				1.474	1,48 %	273.694.968,90	2,94 %	71	1,79 %	266.797,09	5,49 %	1.473	1,48 %	273.428.171,81	2,94 %
192.000,00	203.999,99				1.111	1,12 %	219.681.466,02	2,36 %	71	1,79 %	243.232,70	5,00 %	1.110	1,12 %	219.438.233,32	2,36 %
204.000,00	215.999,99				840	0,85 %	176.280.575,40	1,89 %	40	1,01 %	239.999,95	4,94 %	839	0,84 %	176.040.575,45	1,89 %
216.000,00	227.999,99				614	0,62 %	136.095.294,17	1,46 %	21	0,53 %	23.592,09	0,49 %	614	0,62 %	136.071.702,08	1,46 %
228.000,00	239.999,99				489	0,49 %	114.329.911,14	1,23 %	14	0,35 %	12.448,36	0,26 %	489	0,49 %	114.317.462,78	1,23 %
240.000,00	251.999,99				340	0,34 %	83.532.996,08	0,90 %	16	0,40 %	250.591,38	5,15 %	339	0,34 %	83.282.404,70	0,90 %
252.000,00	263.999,99				297	0,30 %	76.545.920,72	0,82 %	14	0,35 %	35.870,90	0,74 %	297	0,30 %	76.510.049,82	0,82 %
264.000,00	275.999,99				206	0,21 %	55.686.549,99	0,60 %	9	0,23 %	19.056,01	0,39 %	206	0,21 %	55.667.493,98	0,60 %
276.000,00	287.999,99				158	0,16 %	44.583.148,36	0,48 %	5	0,13 %	2.271,52	0,05 %	158	0,16 %	44.580.876,84	0,48 %
288.000,00	299.999,99				134	0,13 %	39.361.257,98	0,42 %	4	0,10 %	16.230,22	0,33 %	134	0,13 %	39.345.027,76	0,42 %
300.000,00	311.999,99				103	0,10 %	31.525.077,24	0,34 %	4	0,10 %	5.583,36	0,11 %	103	0,10 %	31.519.493,88	0,34 %
312.000,00	323.999,99				82	0,08 %	26.045.493,11	0,28 %	3	0,08 %	2.201,88	0,05 %	82	0,08 %	26.043.291,23	0,28 %
324.000,00	335.999,99				65	0,07 %	21.437.100,77	0,23 %	3	0,08 %	9.463,27	0,19 %	65	0,07 %	21.427.637,50	0,23 %
336.000,00	347.999,99				63	0,06 %	21.570.322,36	0,23 %	6	0,15 %	19.573,53	0,40 %	63	0,06 %	21.550.748,83	0,23 %
348.000,00	359.999,99				48	0,05 %	17.017.405,69	0,18 %	3	0,08 %	9.230,93	0,19 %	48	0,05 %	17.008.174,76	0,18 %
360.000,00	371.999,99				46	0,05 %	16.812.676,14	0,18 %	2	0,05 %	2.394,14	0,05 %	46	0,05 %	16.810.282,00	0,18 %
372.000,00	383.999,99				36	0,04 %	13.612.159,73	0,15 %	2	0,05 %	1.173,65	0,02 %	36	0,04 %	13.610.986,08	0,15 %
384.000,00	395.999,99				28	0,03 %	10.900.953,23	0,12 %	1	0,03 %	2.097,99	0,04 %	28	0,03 %	10.898.855,24	0,12 %
396.000,00	407.999,99				25	0,03 %	10.021.204,78	0,11 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	25	0,03 %	10.021.204,78	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: 31/07/2024

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	19	0,02 %	7.866.148,79	0,08 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	19	0,02 %	7.866.148,79	0,08 %
420.000,00	431.999,99	19	0,02 %	8.081.674,04	0,09 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	19	0,02 %	8.081.674,04	0,09 %
432.000,00	443.999,99	26	0,03 %	11.416.983,81	0,12 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	26	0,03 %	11.416.983,81	0,12 %
444.000,00	455.999,99	16	0,02 %	7.210.321,91	0,08 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	16	0,02 %	7.210.321,91	0,08 %
456.000,00	467.999,99	14	0,01 %	6.444.266,10	0,07 %	1	0,03 %	1.248,64	0,03 %	14	0,01 %	6.443.017,46	0,07 %
468.000,00	479.999,99	13	0,01 %	6.167.322,04	0,07 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	13	0,01 %	6.167.322,04	0,07 %
480.000,00	491.999,99	8	0,01 %	3.884.670,21	0,04 %	1	0,03 %	1.359,24	0,03 %	8	0,01 %	3.883.310,97	0,04 %
492.000,00	503.999,99	8	0,01 %	3.970.280,32	0,04 %	1	0,03 %	1.340,49	0,03 %	8	0,01 %	3.968.939,83	0,04 %
504.000,00	515.999,99	10	0,01 %	5.092.037,27	0,05 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	10	0,01 %	5.092.037,27	0,05 %
516.000,00	527.999,99	5	0,01 %	2.608.364,84	0,03 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	5	0,01 %	2.608.364,84	0,03 %
528.000,00	539.999,99	3	0,00 %	1.610.839,11	0,02 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	3	0,00 %	1.610.839,11	0,02 %
540.000,00	551.999,99	10	0,01 %	5.468.321,60	0,06 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	10	0,01 %	5.468.321,60	0,06 %
552.000,00	563.999,99	6	0,01 %	3.345.291,82	0,04 %	1	0,03 %	858,78	0,02 %	6	0,01 %	3.344.433,04	0,04 %
564.000,00	575.999,99	3	0,00 %	1.704.853,47	0,02 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	3	0,00 %	1.704.853,47	0,02 %
576.000,00	587.999,99	3	0,00 %	1.744.040,86	0,02 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	3	0,00 %	1.744.040,86	0,02 %
588.000,00	599.999,99	9	0,01 %	5.326.230,99	0,06 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	9	0,01 %	5.326.230,99	0,06 %
600.000,00	611.999,99	3	0,00 %	1.827.555,62	0,02 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	3	0,00 %	1.827.555,62	0,02 %
612.000,00	623.999,99	3	0,00 %	1.857.031,08	0,02 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	3	0,00 %	1.857.031,08	0,02 %
624.000,00	635.999,99	2	0,00 %	1.260.003,73	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	2	0,00 %	1.260.003,73	0,01 %
636.000,00	647.999,99	1	0,00 %	647.526,64	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	647.526,64	0,01 %
648.000,00	659.999,99	1	0,00 %	652.878,48	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	652.878,48	0,01 %
660.000,00	671.999,99	3	0,00 %	1.993.480,66	0,02 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	3	0,00 %	1.993.480,66	0,02 %
672.000,00	683.999,99	3	0,00 %	2.032.793,72	0,02 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	3	0,00 %	2.032.793,72	0,02 %
684.000,00	695.999,99	1	0,00 %	691.878,50	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	691.878,50	0,01 %
696.000,00	707.999,99	1	0,00 %	697.839,67	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	697.839,67	0,01 %
708.000,00	719.999,99	1	0,00 %	717.271,74	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	717.271,74	0,01 %
720.000,00	731.999,99	2	0,00 %	1.452.215,43	0,02 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	2	0,00 %	1.452.215,43	0,02 %
744.000,00	755.999,99	1	0,00 %	746.849,64	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	746.849,64	0,01 %
768.000,00	779.999,99	1	0,00 %	770.505,48	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	770.505,48	0,01 %
780.000,00	791.999,99	2	0,00 %	1.576.398,84	0,02 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	2	0,00 %	1.576.398,84	0,02 %
816.000,00	827.999,99	1	0,00 %	827.510,52	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	827.510,52	0,01 %
852.000,00	863.999,99	1	0,00 %	855.830,34	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	855.830,34	0,01 %
876.000,00	887.999,99	1	0,00 %	883.455,99	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	883.455,99	0,01 %
888.000,00	899.999,99	1	0,00 %	891.056,03	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	891.056,03	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: 31/07/2024

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	%	
924.000,00	935.999,99	1	0,00 %	927.105,51	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	927.105,51	0,01 %
960.000,00	971.999,99	1	0,00 %	962.451,78	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	962.451,78	0,01 %
996.000,00	1.007.999,99	1	0,00 %	1.002.994,72	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	1.002.994,72	0,01 %
1.008.000,00	1.019.999,99	1	0,00 %	1.014.524,30	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	1.014.524,30	0,01 %
1.296.000,00	1.307.999,99	1	0,00 %	1.297.279,13	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	1.297.279,13	0,01 %
1.308.000,00	1.319.999,99	1	0,00 %	1.319.701,82	0,01 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	1.319.701,82	0,01 %
Total :		99.359	100,00	9.304.711.031,92	100,00	3.973	100,00	4.862.042,79	100,00	99.329	100,00	9.299.848.989,13	100,00
Media simple / Average :				93.647,39				1.223,77				93.626,73	
Mínimo / Minimum :				0,52				0,02				0,52	
Máximo / Maximum :				1.319.701,82				242.602,66				1.319.701,82	