

BBVA RMBS 23 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	3	0,01	18.661,63	0,00	0	0,00	0,00	0,00	3	0,01	18.661,63	0,00
12.000,00	23.999,99	8	0,02	142.116,16	0,00	0	0,00	0,00	0,00	8	0,02	142.116,16	0,00
24.000,00	35.999,99	1.029	2,14	33.752.599,78	0,63	49	3,82	8.931,12	2,65	1.029	2,14	33.743.668,66	0,63
36.000,00	47.999,99	3.012	6,26	127.767.419,17	2,38	94	7,32	16.028,07	4,76	3.012	6,26	127.751.391,10	2,38
48.000,00	59.999,99	4.277	8,89	231.946.108,52	4,31	115	8,96	20.783,58	6,17	4.277	8,89	231.925.324,94	4,31
60.000,00	71.999,99	4.814	10,01	318.068.873,93	5,92	129	10,05	26.327,53	7,81	4.814	10,01	318.042.546,40	5,92
72.000,00	83.999,99	5.004	10,40	390.646.987,32	7,27	156	12,15	34.153,13	10,13	5.004	10,40	390.612.834,19	7,27
84.000,00	95.999,99	4.811	10,00	432.465.589,28	8,05	134	10,44	32.653,01	9,69	4.811	10,00	432.432.936,27	8,05
96.000,00	107.999,99	4.800	9,98	488.367.681,42	9,09	136	10,59	34.541,31	10,25	4.800	9,98	488.333.140,11	9,09
108.000,00	119.999,99	3.988	8,29	454.380.280,68	8,45	89	6,93	24.886,17	7,38	3.988	8,29	454.355.394,51	8,45
120.000,00	131.999,99	3.351	6,97	421.736.610,36	7,85	79	6,15	22.098,16	6,56	3.351	6,97	421.714.512,20	7,85
132.000,00	143.999,99	2.688	5,59	369.950.851,10	6,88	75	5,84	22.642,11	6,72	2.688	5,59	369.928.208,99	6,88
144.000,00	155.999,99	2.099	4,36	314.338.096,03	5,85	48	3,74	14.757,57	4,38	2.099	4,36	314.323.338,46	5,85
156.000,00	167.999,99	1.686	3,51	272.799.233,41	5,07	41	3,19	13.420,21	3,98	1.686	3,51	272.785.813,20	5,07
168.000,00	179.999,99	1.321	2,75	229.491.873,42	4,27	40	3,12	14.105,72	4,19	1.321	2,75	229.477.767,70	4,27
180.000,00	191.999,99	973	2,02	180.822.907,22	3,36	20	1,56	7.336,06	2,18	973	2,02	180.815.571,16	3,36
192.000,00	203.999,99	816	1,70	161.228.890,64	3,00	24	1,87	9.597,39	2,85	816	1,70	161.219.293,25	3,00
204.000,00	215.999,99	624	1,30	130.833.946,48	2,43	11	0,86	7.175,83	2,13	624	1,30	130.826.770,65	2,43
216.000,00	227.999,99	502	1,04	111.458.984,60	2,07	10	0,78	4.980,45	1,48	502	1,04	111.454.004,15	2,07
228.000,00	239.999,99	394	0,82	92.151.725,30	1,71	7	0,55	3.981,08	1,18	394	0,82	92.147.744,22	1,71
240.000,00	251.999,99	358	0,74	87.973.939,37	1,64	4	0,31	2.672,79	0,79	358	0,74	87.971.266,58	1,64
252.000,00	263.999,99	237	0,49	61.145.385,72	1,14	5	0,39	2.771,63	0,82	237	0,49	61.142.614,09	1,14
264.000,00	275.999,99	199	0,41	53.724.466,94	1,00	2	0,16	948,67	0,28	199	0,41	53.723.518,27	1,00
276.000,00	287.999,99	158	0,33	44.602.881,01	0,83	0	0,00	0,00	0,00	158	0,33	44.602.881,01	0,83
288.000,00	299.999,99	162	0,34	47.553.509,01	0,88	1	0,08	319,64	0,09	162	0,34	47.553.189,37	0,88
300.000,00	311.999,99	115	0,24	35.104.874,53	0,65	4	0,31	2.213,20	0,66	115	0,24	35.102.661,33	0,65
312.000,00	323.999,99	102	0,21	32.414.149,13	0,60	3	0,23	1.896,60	0,56	102	0,21	32.412.252,53	0,60
324.000,00	335.999,99	75	0,16	24.753.434,83	0,46	2	0,16	1.696,39	0,50	75	0,16	24.751.738,44	0,46

BBVA RMBS 23 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 <i>Principal Intervals</i>	Saldo Vivo de Principal <i>Outstanding Principal Balance</i>				Principal Vencido Impagado <i>Overdue Principal</i>				Principal Pendiente Vencimiento <i>Outstanding Principal</i>				
	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	
336.000,00	347.999,99	69	0,14	23.557.457,61	0,44	0	0,00	0,00	0,00	69	0,14	23.557.457,61	0,44
348.000,00	359.999,99	48	0,10	16.974.598,70	0,32	0	0,00	0,00	0,00	48	0,10	16.974.598,70	0,32
360.000,00	371.999,99	57	0,12	20.893.343,53	0,39	0	0,00	0,00	0,00	57	0,12	20.893.343,53	0,39
372.000,00	383.999,99	31	0,06	11.686.489,48	0,22	1	0,08	500,17	0,15	31	0,06	11.685.989,31	0,22
384.000,00	395.999,99	34	0,07	13.264.341,03	0,25	1	0,08	581,33	0,17	34	0,07	13.263.759,70	0,25
396.000,00	407.999,99	29	0,06	11.662.911,61	0,22	1	0,08	1.326,72	0,39	29	0,06	11.661.584,89	0,22
408.000,00	419.999,99	29	0,06	12.028.215,12	0,22	0	0,00	0,00	0,00	29	0,06	12.028.215,12	0,22
420.000,00	431.999,99	23	0,05	9.802.021,18	0,18	0	0,00	0,00	0,00	23	0,05	9.802.021,18	0,18
432.000,00	443.999,99	17	0,04	7.454.236,60	0,14	0	0,00	0,00	0,00	17	0,04	7.454.236,60	0,14
444.000,00	455.999,99	10	0,02	4.496.864,43	0,08	0	0,00	0,00	0,00	10	0,02	4.496.864,43	0,08
456.000,00	467.999,99	12	0,02	5.530.393,11	0,10	0	0,00	0,00	0,00	12	0,02	5.530.393,11	0,10
468.000,00	479.999,99	9	0,02	4.271.503,16	0,08	0	0,00	0,00	0,00	9	0,02	4.271.503,16	0,08
480.000,00	491.999,99	16	0,03	7.755.425,29	0,14	1	0,08	946,31	0,28	16	0,03	7.754.478,98	0,14
492.000,00	503.999,99	9	0,02	4.470.057,55	0,08	0	0,00	0,00	0,00	9	0,02	4.470.057,55	0,08
504.000,00	515.999,99	5	0,01	2.549.103,80	0,05	0	0,00	0,00	0,00	5	0,01	2.549.103,80	0,05
516.000,00	527.999,99	5	0,01	2.608.867,57	0,05	0	0,00	0,00	0,00	5	0,01	2.608.867,57	0,05
528.000,00	539.999,99	9	0,02	4.808.667,98	0,09	0	0,00	0,00	0,00	9	0,02	4.808.667,98	0,09
540.000,00	551.999,99	4	0,01	2.173.079,66	0,04	0	0,00	0,00	0,00	4	0,01	2.173.079,66	0,04
552.000,00	563.999,99	9	0,02	5.017.199,71	0,09	0	0,00	0,00	0,00	9	0,02	5.017.199,71	0,09
564.000,00	575.999,99	4	0,01	2.284.534,18	0,04	0	0,00	0,00	0,00	4	0,01	2.284.534,18	0,04
576.000,00	587.999,99	4	0,01	2.330.993,80	0,04	0	0,00	0,00	0,00	4	0,01	2.330.993,80	0,04
588.000,00	599.999,99	1	0,00	590.143,97	0,01	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	590.143,97	0,01
600.000,00	611.999,99	3	0,01	1.817.005,50	0,03	0	0,00	0,00	0,00	3	0,01	1.817.005,50	0,03
612.000,00	623.999,99	4	0,01	2.473.766,51	0,05	0	0,00	0,00	0,00	4	0,01	2.473.766,51	0,05
636.000,00	647.999,99	4	0,01	2.568.455,46	0,05	0	0,00	0,00	0,00	4	0,01	2.568.455,46	0,05
648.000,00	659.999,99	2	0,00	1.301.895,93	0,02	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.301.895,93	0,02
660.000,00	671.999,99	4	0,01	2.652.280,23	0,05	1	0,08	1.285,09	0,38	4	0,01	2.650.995,14	0,05
672.000,00	683.999,99	2	0,00	1.358.868,75	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.358.868,75	0,03

BBVA RMBS 23 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 <i>Principal Intervals</i>	Saldo Vivo de Principal <i>Outstanding Principal Balance</i>				Principal Vencido Impagado <i>Overdue Principal</i>				Principal Pendiente Vencimiento <i>Outstanding Principal</i>				
	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	
684.000,00	695.999,99	2	0,00	1.382.793,02	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.382.793,02	0,03
696.000,00	707.999,99	1	0,00	704.437,99	0,01	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	704.437,99	0,01
708.000,00	719.999,99	2	0,00	1.426.815,95	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.426.815,95	0,03
720.000,00	731.999,99	1	0,00	730.771,07	0,01	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	730.771,07	0,01
732.000,00	743.999,99	1	0,00	738.708,56	0,01	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	738.708,56	0,01
744.000,00	755.999,99	2	0,00	1.507.002,08	0,03	1	0,08	1.436,97	0,43	2	0,00	1.505.565,11	0,03
756.000,00	767.999,99	6	0,01	4.572.634,12	0,09	0	0,00	0,00	0,00	6	0,01	4.572.634,12	0,09
768.000,00	779.999,99	1	0,00	774.742,65	0,01	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	774.742,65	0,01
792.000,00	803.999,99	1	0,00	799.270,74	0,01	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	799.270,74	0,01
804.000,00	815.999,99	3	0,01	2.430.346,56	0,05	0	0,00	0,00	0,00	3	0,01	2.430.346,56	0,05
828.000,00	839.999,99	1	0,00	832.476,72	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	832.476,72	0,02
852.000,00	863.999,99	1	0,00	853.101,21	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	853.101,21	0,02
888.000,00	899.999,99	1	0,00	894.920,22	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	894.920,22	0,02
924.000,00	935.999,99	2	0,00	1.850.585,79	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.850.585,79	0,03
936.000,00	947.999,99	1	0,00	936.869,74	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	936.869,74	0,02
972.000,00	983.999,99	1	0,00	977.416,67	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	977.416,67	0,02
984.000,00	995.999,99	1	0,00	984.288,23	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	984.288,23	0,02
996.000,00	1.007.999,99	1	0,00	1.000.759,72	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.000.759,72	0,02
1.008.000,00	1.019.999,99	1	0,00	1.009.862,52	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.009.862,52	0,02
1.044.000,00	1.055.999,99	1	0,00	1.053.664,85	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.053.664,85	0,02
1.056.000,00	1.067.999,99	1	0,00	1.067.318,36	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.067.318,36	0,02
1.080.000,00	1.091.999,99	1	0,00	1.081.331,59	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.081.331,59	0,02
1.092.000,00	1.103.999,99	1	0,00	1.103.624,20	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.103.624,20	0,02
1.140.000,00	1.151.999,99	2	0,00	2.298.348,38	0,04	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	2.298.348,38	0,04
1.272.000,00	1.283.999,99	1	0,00	1.278.294,83	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.278.294,83	0,02
1.620.000,00	1.631.999,99	2	0,00	3.251.077,68	0,06	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	3.251.077,68	0,06
1.872.000,00	1.883.999,99	1	0,00	1.874.919,10	0,03	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.874.919,10	0,03

BBVA RMBS 23 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 <i>Principal Intervals</i>	Saldo Vivo de Principal <i>Outstanding Principal Balance</i>				Principal Vencido Impagado <i>Overdue Principal</i>				Principal Pendiente Vencimiento <i>Outstanding Principal</i>			
	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%
Total :	48.099	100,00	5.375.441.180,99	100,00	1.284	100,00	336.994,01	100,00	48.099	100,00	5.375.104.186,98	100,00
Media Ponderada / <i>Weighted Average</i> :												
Media Simple / <i>Average</i> :			111.757,86				262,46				111.750,85	
Mínimo / <i>Minimum</i> :			92,14				12,95				92,14	
Máximo / <i>Maximum</i> :			1.874.919,10				1.911,90				1.874.919,10	