

BBVA RMBS 23 Fondo de Titulización

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Intervalos de Fecha de Vencimiento Final / Distribution by Final Maturity Date Intervals

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

Fecha / Date: 31/08/2024

Divisa / Currency: EUR

Intervalos anuales Annual Intervals	Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance				Principal Vencido Impagado Overdue Principal				Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal				Tipo Interés Interest Rate	Vida residual Residual Life
	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Media Pond. W. Average	M. Pond. Meses W. Avg. Months
2025	4	0,01	162.847,80	0,00	0	0,00	0,00	0,00	4	0,01	162.847,80	0,00	4,307%	13,876
2026	14	0,03	570.196,13	0,01	0	0,00	0,00	0,00	14	0,03	570.196,13	0,01	3,802%	24,099
2027	96	0,20	4.090.901,04	0,08	6	0,39	4.030,49	0,97	96	0,20	4.086.870,55	0,08	4,356%	36,229
2028	62	0,13	2.547.119,66	0,05	1	0,06	765,81	0,18	62	0,13	2.546.353,85	0,05	4,178%	46,706
2029	129	0,27	5.675.385,34	0,11	3	0,19	1.752,55	0,42	129	0,27	5.673.632,79	0,11	4,321%	59,244
2030	150	0,31	7.270.709,62	0,14	6	0,39	2.674,05	0,65	150	0,31	7.268.035,57	0,14	4,087%	71,134
2031	227	0,47	12.237.724,28	0,23	7	0,45	5.735,08	1,38	227	0,47	12.231.989,20	0,23	3,974%	82,819
2032	634	1,32	37.518.965,39	0,70	18	1,16	11.084,98	2,67	634	1,32	37.507.880,41	0,70	4,104%	95,367
2033	532	1,11	37.211.205,77	0,70	16	1,03	5.692,52	1,37	532	1,11	37.205.513,25	0,70	3,513%	107,221
2034	602	1,25	43.303.466,36	0,81	26	1,67	10.748,01	2,59	602	1,25	43.292.718,35	0,81	3,740%	118,493
2035	650	1,35	52.616.926,58	0,98	34	2,19	15.971,22	3,85	650	1,35	52.600.955,36	0,98	3,704%	131,234
2036	749	1,56	64.120.416,98	1,20	28	1,80	9.074,55	2,19	749	1,56	64.111.342,43	1,20	3,582%	142,877
2037	2.313	4,82	192.399.334,08	3,60	80	5,15	32.912,28	7,94	2.313	4,82	192.366.421,80	3,60	4,047%	155,042
2038	1.323	2,76	121.372.241,47	2,27	39	2,51	14.335,67	3,46	1.323	2,76	121.357.905,80	2,27	3,349%	167,377
2039	1.059	2,21	96.858.187,02	1,81	31	2,00	9.611,99	2,32	1.059	2,21	96.848.575,03	1,81	3,532%	178,193
2040	564	1,18	59.523.823,56	1,11	10	0,64	2.897,26	0,70	564	1,18	59.520.926,30	1,11	3,381%	190,919
2041	674	1,40	70.415.415,53	1,32	16	1,03	4.556,98	1,10	674	1,40	70.410.858,55	1,32	3,336%	203,100
2042	1.843	3,84	191.399.265,66	3,58	82	5,28	21.570,88	5,21	1.843	3,84	191.377.694,78	3,58	3,811%	214,876
2043	1.948	4,06	204.525.559,91	3,83	46	2,96	13.376,18	3,23	1.948	4,06	204.512.183,73	3,83	3,421%	227,522
2044	2.343	4,88	222.945.751,24	4,17	84	5,41	18.022,51	4,35	2.343	4,88	222.927.728,73	4,17	4,124%	238,581
2045	2.916	6,08	283.441.454,78	5,30	72	4,64	17.068,90	4,12	2.916	6,08	283.424.385,88	5,30	4,379%	251,398
2046	3.705	7,72	385.834.627,06	7,22	117	7,53	25.323,94	6,11	3.705	7,72	385.809.303,12	7,22	3,716%	262,577
2047	8.033	16,74	955.313.791,63	17,88	387	24,92	94.493,34	22,80	8.033	16,74	955.219.298,29	17,88	3,930%	274,853
2048	4.828	10,06	570.007.399,48	10,67	168	10,82	38.263,15	9,23	4.828	10,06	569.969.136,33	10,67	3,424%	286,299
2049	2.410	5,02	302.174.159,19	5,65	77	4,96	16.327,66	3,94	2.410	5,02	302.157.831,53	5,65	3,661%	297,671
2050	1.055	2,20	139.618.973,53	2,61	32	2,06	7.455,51	1,80	1.055	2,20	139.611.518,02	2,61	3,439%	310,926
2051	1.071	2,23	151.972.376,99	2,84	27	1,74	4.589,57	1,11	1.071	2,23	151.967.787,42	2,84	2,886%	321,871
2052	1.452	3,03	197.120.438,53	3,69	28	1,80	6.532,57	1,58	1.452	3,03	197.113.905,96	3,69	2,886%	336,285
2053	4.707	9,81	693.751.554,12	12,98	58	3,73	12.400,90	2,99	4.707	9,81	693.739.153,22	12,98	2,887%	347,843
2054	1.169	2,44	157.107.322,74	2,94	31	2,00	4.482,47	1,08	1.169	2,44	157.102.840,27	2,94	2,096%	354,207

BBVA RMBS 23 Fondo de Titulización

Cartera de Activos Titulizados / *Portfolio of Securitised Assets*

Distribución por Intervalos de Fecha de Vencimiento Final / *Distribution by Final Maturity Date Intervals*

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

Fecha / *Date*: 31/08/2024

Divisa / *Currency*: EUR

Intervalos anuales <i>Annual 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>				Tipo Interés <i>Interest Rate</i>	Vida residual <i>Residual Life</i>
	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Media Pond. <i>W. Average</i>	M. Pond. Meses <i>W. Avg. Months</i>
2055	334	0,70	33.941.169,34	0,64	12	0,77	1.172,20	0,28	334	0,70	33.939.997,14	0,64	5,310%	371,370
2056	203	0,42	22.968.847,87	0,43	8	0,52	1.163,95	0,28	203	0,42	22.967.683,92	0,43	5,024%	381,266
2057	91	0,19	11.536.458,11	0,22	3	0,19	338,77	0,08	91	0,19	11.536.119,34	0,22	4,647%	395,386
2058	58	0,12	7.318.523,63	0,14	0	0,00	0,00	0,00	58	0,12	7.318.523,63	0,14	4,478%	405,376
2059	2	0,00	252.885,67	0,00	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	252.885,67	0,00	2,831%	419,085
2060	3	0,01	350.702,15	0,01	0	0,00	0,00	0,00	3	0,01	350.702,15	0,01	3,848%	429,262
2061	8	0,02	1.711.878,11	0,03	0	0,00	0,00	0,00	8	0,02	1.711.878,11	0,03	4,813%	442,968
2062	10	0,02	1.437.801,40	0,03	0	0,00	0,00	0,00	10	0,02	1.437.801,40	0,03	4,238%	455,517
2063	8	0,02	1.390.230,44	0,03	0	0,00	0,00	0,00	8	0,02	1.390.230,44	0,03	3,034%	468,376
Total :	47.979	100,00	5.344.016.038,19	100,00	1.553	100,00	414.425,94	100,00	47.979	100,00	5.343.601.612,25	100,00		
Media Ponderada / <i>Weighted Average</i> :													3,560%	269,446
Media Simple / <i>Average</i> :			111.382,40				266,86				111.373,76		3,728%	257,111
Mínimo / <i>Minimum</i> :			91,89				23,04				91,89		0,000%	31/03/2025
Máximo / <i>Maximum</i> :			1.871.590,65				2.873,24				1.871.590,65		8,773%	31/12/2063