

HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Intervalos de Principal / Distribution by Principal Intervals

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

Fecha / Date: 31/01/2024

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 | 315 | 12,80 | 1.735.687,76 | 1,12 | 16 | 7,24 | 7.931,37 | 0,46 | 313 | 12,79 | 1.727.756,39 | 1,12 |
| 12.000,00 | 23.999,99 | 320 | 13,00 | 5.692.290,43 | 3,66 | 35 | 15,84 | 30.382,70 | 1,77 | 319 | 13,03 | 5.661.907,73 | 3,68 |
| 24.000,00 | 35.999,99 | 240 | 9,75 | 7.074.227,88 | 4,55 | 18 | 8,14 | 34.138,19 | 1,99 | 239 | 9,76 | 7.040.089,69 | 4,58 |
| 36.000,00 | 47.999,99 | 247 | 10,04 | 10.346.931,00 | 6,65 | 23 | 10,41 | 7.647,32 | 0,45 | 247 | 10,09 | 10.339.283,68 | 6,72 |
| 48.000,00 | 59.999,99 | 217 | 8,82 | 11.865.499,91 | 7,63 | 13 | 5,88 | 5.955,36 | 0,35 | 217 | 8,86 | 11.859.544,55 | 7,71 |
| 60.000,00 | 71.999,99 | 179 | 7,27 | 11.790.484,22 | 7,58 | 18 | 8,14 | 50.650,08 | 2,96 | 179 | 7,31 | 11.739.834,14 | 7,63 |
| 72.000,00 | 83.999,99 | 193 | 7,84 | 15.089.002,83 | 9,70 | 18 | 8,14 | 93.922,53 | 5,48 | 192 | 7,84 | 14.995.080,30 | 9,75 |
| 84.000,00 | 95.999,99 | 170 | 6,91 | 15.347.542,49 | 9,87 | 14 | 6,33 | 96.423,90 | 5,63 | 169 | 6,90 | 15.251.118,59 | 9,91 |
| 96.000,00 | 107.999,99 | 139 | 5,65 | 14.154.867,79 | 9,10 | 15 | 6,79 | 13.892,46 | 0,81 | 139 | 5,68 | 14.140.975,33 | 9,19 |
| 108.000,00 | 119.999,99 | 131 | 5,32 | 14.878.232,89 | 9,56 | 15 | 6,79 | 16.922,25 | 0,99 | 131 | 5,35 | 14.861.310,64 | 9,66 |
| 120.000,00 | 131.999,99 | 86 | 3,49 | 10.740.541,63 | 6,90 | 9 | 4,07 | 6.676,07 | 0,39 | 86 | 3,51 | 10.733.865,56 | 6,98 |
| 132.000,00 | 143.999,99 | 76 | 3,09 | 10.433.758,36 | 6,71 | 5 | 2,26 | 138.961,77 | 8,11 | 75 | 3,06 | 10.294.796,59 | 6,69 |
| 144.000,00 | 155.999,99 | 58 | 2,36 | 8.699.964,09 | 5,59 | 7 | 3,17 | 454.375,38 | 26,53 | 55 | 2,25 | 8.245.588,71 | 5,36 |
| 156.000,00 | 167.999,99 | 28 | 1,14 | 4.507.184,18 | 2,90 | 5 | 2,26 | 4.055,87 | 0,24 | 28 | 1,14 | 4.503.128,31 | 2,93 |
| 168.000,00 | 179.999,99 | 15 | 0,61 | 2.576.522,38 | 1,66 | 1 | 0,45 | 170.177,94 | 9,94 | 14 | 0,57 | 2.406.344,44 | 1,56 |
| 180.000,00 | 191.999,99 | 12 | 0,49 | 2.229.925,36 | 1,43 | 2 | 0,90 | 1.501,95 | 0,09 | 12 | 0,49 | 2.228.423,41 | 1,45 |
| 192.000,00 | 203.999,99 | 12 | 0,49 | 2.388.620,28 | 1,54 | 3 | 1,36 | 5.222,93 | 0,30 | 12 | 0,49 | 2.383.397,35 | 1,55 |
| 204.000,00 | 215.999,99 | 3 | 0,12 | 635.327,35 | 0,41 | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3 | 0,12 | 635.327,35 | 0,41 |
| 216.000,00 | 227.999,99 | 6 | 0,24 | 1.342.862,64 | 0,86 | 2 | 0,90 | 225.402,47 | 13,16 | 5 | 0,20 | 1.117.460,17 | 0,73 |
| 228.000,00 | 239.999,99 | 1 | 0,04 | 234.557,03 | 0,15 | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1 | 0,04 | 234.557,03 | 0,15 |
| 240.000,00 | 251.999,99 | 4 | 0,16 | 977.434,08 | 0,63 | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4 | 0,16 | 977.434,08 | 0,64 |
| 252.000,00 | 263.999,99 | 4 | 0,16 | 1.043.256,25 | 0,67 | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4 | 0,16 | 1.043.256,25 | 0,68 |
| 264.000,00 | 275.999,99 | 1 | 0,04 | 267.004,73 | 0,17 | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1 | 0,04 | 267.004,73 | 0,17 |
| 288.000,00 | 299.999,99 | 1 | 0,04 | 292.124,69 | 0,19 | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1 | 0,04 | 292.124,69 | 0,19 |
| 336.000,00 | 347.999,99 | 2 | 0,08 | 687.293,81 | 0,44 | 1 | 0,45 | 345.617,39 | 20,18 | 1 | 0,04 | 341.676,42 | 0,22 |
| 540.000,00 | 551.999,99 | 1 | 0,04 | 541.340,11 | 0,35 | 1 | 0,45 | 3.045,08 | 0,18 | 1 | 0,04 | 538.295,03 | 0,35 |

HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / *Portfolio of Securitised Assets*

Distribución por Intervalos de Principal / *Distribution by Principal Intervals*

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

Fecha / *Date*: 31/01/2024

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 : | 2.461 | 100,00 | 155.572.484,17 | 100,00 | 221 | 100,00 | 1.712.903,01 | 100,00 | 2.448 | 100,00 | 153.859.581,16 | 100,00 |
| Media Ponderada / <i>Weighted Average</i> : | | | | | | | | | | | | |
| Media Simple / <i>Average</i> : | | | 63.215,15 | | | | 7.750,69 | | | | 62.851,14 | |
| Mínimo / <i>Minimum</i> : | | | 88,08 | | | | 5,28 | | | | 88,08 | |
| Máximo / <i>Maximum</i> : | | | 541.340,11 | | | | 345.617,39 | | | | 538.295,03 | |