

# HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos

## Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

### Distribución por Intervalos de Relación Principal actual / Valor de Tasación (%CLTV) / Distribution by current Loan-to-Value Ratio (% CLTV) Intervals

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

Fecha / Date: 31/08/2023

Divisa / Currency: EUR

| Intervalos de %CLTV<br>%CLTV Intervals |        | Saldo Vivo de Principal<br>Outstanding Principal Balance |      |                  |      | Principal Vencido Impagado<br>Overdue Principal |       |                  |       | Principal Pendiente Vencimiento<br>Outstanding Principal |      |                  |      | %CLTV Media Ponderada<br>Weighted Average % CLTV |          |
|--|--------|--|------|------------------|------|---|-------|------------------|-------|--|------|------------------|------|--|----------|
|  |        | Num.   | %    | Importe / Amount | %    | Num.  | %     | Importe / Amount | %     | Num.   | %    | Importe / Amount | %    | SVP / OPB  | PPV / OP |
| 0,01                                   | 5,00   | 233  | 9,19 | 3.370.359,22     | 2,04 | 33  | 15,00 | 2.185.718,16     | 91,92 | 216  | 8,57 | 1.184.641,06     | 0,73 | 65,738   | 3,206    |
| 5,01                                   | 10,00  | 178  | 7,02 | 2.937.319,34     | 1,78 | 8   | 3,64  | 3.662,75         | 0,15  | 178  | 7,07 | 2.933.656,59     | 1,80 | 7,846  | 7,837    |
| 10,01                                  | 15,00  | 198  | 7,81 | 5.232.156,34     | 3,17 | 16  | 7,27  | 5.190,70         | 0,22  | 198  | 7,86 | 5.226.965,64     | 3,21 | 12,753   | 12,741   |
| 15,01                                  | 20,00  | 177  | 6,98 | 6.240.145,73     | 3,78 | 17  | 7,73  | 12.027,34        | 0,51  | 177  | 7,03 | 6.228.118,39     | 3,83 | 17,635   | 17,599   |
| 20,01                                  | 25,00  | 211  | 8,32 | 8.390.585,03     | 5,08 | 13  | 5,91  | 4.614,33         | 0,19  | 211  | 8,38 | 8.385.970,70     | 5,15 | 22,637   | 22,625   |
| 25,01                                  | 30,00  | 155  | 6,11 | 7.593.217,50     | 4,60 | 9   | 4,09  | 3.664,71         | 0,15  | 155  | 6,15 | 7.589.552,79     | 4,66 | 27,462   | 27,448   |
| 30,01                                  | 35,00  | 126  | 4,97 | 7.236.153,59     | 4,38 | 10  | 4,55  | 5.128,21         | 0,22  | 126  | 5,00 | 7.231.025,38     | 4,44 | 32,412   | 32,388   |
| 35,01                                  | 40,00  | 124  | 4,89 | 8.811.010,59     | 5,34 | 10  | 4,55  | 5.143,29         | 0,22  | 124  | 4,92 | 8.805.867,30     | 5,41 | 37,456   | 37,434   |
| 40,01                                  | 45,00  | 126  | 4,97 | 10.186.070,77    | 6,17 | 6   | 2,73  | 2.988,68         | 0,13  | 126  | 5,00 | 10.183.082,09    | 6,26 | 42,610   | 42,598   |
| 45,01                                  | 50,00  | 139  | 5,48 | 11.419.592,76    | 6,92 | 11  | 5,00  | 19.394,03        | 0,82  | 139  | 5,52 | 11.400.198,73    | 7,01 | 47,799   | 47,712   |
| 50,01                                  | 55,00  | 127  | 5,01 | 11.991.817,91    | 7,26 | 13  | 5,91  | 7.734,67         | 0,33  | 127  | 5,04 | 11.984.083,24    | 7,37 | 52,682   | 52,649   |
| 55,01                                  | 60,00  | 134  | 5,28 | 13.204.808,05    | 8,00 | 14  | 6,36  | 54.750,73        | 2,30  | 134  | 5,32 | 13.150.057,32    | 8,08 | 57,788   | 57,477   |
| 60,01                                  | 65,00  | 119  | 4,69 | 12.946.437,91    | 7,84 | 17  | 7,73  | 12.517,13        | 0,53  | 119  | 4,72 | 12.933.920,78    | 7,95 | 62,886   | 62,827   |
| 65,01                                  | 70,00  | 106  | 4,18 | 11.705.416,71    | 7,09 | 10  | 4,55  | 7.152,90         | 0,30  | 106  | 4,21 | 11.698.263,81    | 7,19 | 67,698   | 67,655   |
| 70,01                                  | 75,00  | 85   | 3,35 | 9.508.419,75     | 5,76 | 7   | 3,18  | 5.984,54         | 0,25  | 85   | 3,37 | 9.502.435,21     | 5,84 | 72,377   | 72,330   |
| 75,01                                  | 80,00  | 61   | 2,41 | 6.531.241,19     | 3,96 | 7   | 3,18  | 24.874,99        | 1,05  | 61   | 2,42 | 6.506.366,20     | 4,00 | 77,781   | 77,397   |
| 80,01                                  | 85,00  | 49   | 1,93 | 5.710.480,43     | 3,46 | 4   | 1,82  | 2.901,28         | 0,12  | 49   | 1,95 | 5.707.579,15     | 3,51 | 82,532   | 82,489   |
| 85,01                                  | 90,00  | 42   | 1,66 | 4.471.462,27     | 2,71 | 3   | 1,36  | 1.821,91         | 0,08  | 42   | 1,67 | 4.469.640,36     | 2,75 | 87,699   | 87,662   |
| 90,01                                  | 95,00  | 24   | 0,95 | 2.814.685,58     | 1,70 | 2   | 0,91  | 1.856,51         | 0,08  | 24   | 0,95 | 2.812.829,07     | 1,73 | 92,017   | 91,958   |
| 95,01                                  | 100,00 | 27   | 1,06 | 3.143.591,39     | 1,90 | 2   | 0,91  | 1.891,83         | 0,08  | 27   | 1,07 | 3.141.699,56     | 1,93 | 98,189   | 98,131   |
| 100,01                                 | 105,00 | 25   | 0,99 | 3.047.554,72     | 1,85 | 2   | 0,91  | 793,66           | 0,03  | 25   | 0,99 | 3.046.761,06     | 1,87 | 102,679  | 102,653  |
| 105,01                                 | 110,00 | 19   | 0,75 | 2.582.968,83     | 1,56 | 1   | 0,45  | 5.154,40         | 0,22  | 19   | 0,75 | 2.577.814,43     | 1,58 | 108,367  | 108,147  |
| 110,01                                 | 115,00 | 7  | 0,28 | 807.556,21       | 0,49 | 2   | 0,91  | 1.434,78         | 0,06  | 7  | 0,28 | 806.121,43       | 0,50 | 113,537  | 113,340  |
| 115,01                                 | 120,00 | 9  | 0,35 | 1.096.798,23     | 0,66 | 1   | 0,45  | 428,36           | 0,02  | 9  | 0,36 | 1.096.369,87     | 0,67 | 117,380  | 117,335  |
| 120,01                                 | 125,00 | 6  | 0,24 | 916.079,20       | 0,55 | 0   | 0,00  | 0,00             | 0,00  | 6  | 0,24 | 916.079,20       | 0,56 | 122,580  | 122,580  |
| 125,01                                 | 130,00 | 5  | 0,20 | 537.481,75       | 0,33 | 0   | 0,00  | 0,00             | 0,00  | 5  | 0,20 | 537.481,75       | 0,33 | 126,843  | 126,843  |
| 130,01                                 | 135,00 | 4  | 0,16 | 446.488,54       | 0,27 | 0   | 0,00  | 0,00             | 0,00  | 4  | 0,16 | 446.488,54       | 0,27 | 132,906  | 132,906  |
| 135,01                                 | 140,00 | 5  | 0,20 | 602.247,22       | 0,36 | 1   | 0,45  | 479,58           | 0,02  | 5  | 0,20 | 601.767,64       | 0,37 | 138,176  | 138,067  |
| 140,01                                 | 145,00 | 3  | 0,12 | 353.648,62       | 0,21 | 0   | 0,00  | 0,00             | 0,00  | 3  | 0,12 | 353.648,62       | 0,22 | 141,979  | 141,979  |
| 145,01                                 | 150,00 | 2  | 0,08 | 270.671,14       | 0,16 | 0   | 0,00  | 0,00             | 0,00  | 2  | 0,08 | 270.671,14       | 0,17 | 146,532  | 146,532  |

Medias ponderadas por el saldo vivo de principal (SVP) y por el principal pendiente de vencimiento (PPV).  
Averages weighted by the outstanding principal balance (OPB) and by the outstanding principal (OP).

# HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / *Portfolio of Securitised Assets*

Distribución por Intervalos de Relación Principal actual / Valor de Tasación (%CLTV) / *Distribution by current Loan-to-Value Ratio (% CLTV) Intervals*

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

Fecha / *Date*: 31/08/2023

Divisa / *Currency*: EUR

| Intervalos de %CLTV<br>%CLTV Intervals      | Saldo Vivo de Principal<br><i>Outstanding Principal Balance</i> |               |                       |               | Principal Vencido Impagado<br><i>Overdue Principal</i> |               |                     |               | Principal Pendiente Vencimiento<br><i>Outstanding Principal</i> |               |                       |               | %CLTV Media Ponderada<br><i>Weighted Average % CLTV</i> |                |
|---|---|---------------|-----------------------|---------------|--|---------------|---------------------|---------------|---|---------------|-----------------------|---------------|---|----------------|
|   | Num.  | %             | Importe / Amount      | %             | Num.   | %             | Importe / Amount    | %             | Num.  | %             | Importe / Amount      | %             | SVP / OPB   | PPV / OP       |
| 150,01 155,00                               | 2   | 0,08          | 223.817,28            | 0,14          | 0  | 0,00          | 0,00                | 0,00          | 2   | 0,08          | 223.817,28            | 0,14          | 151,645   | 151,645        |
| 155,01 160,00                               | 1   | 0,04          | 71.764,06             | 0,04          | 0  | 0,00          | 0,00                | 0,00          | 1   | 0,04          | 71.764,06             | 0,04          | 155,562   | 155,562        |
| 160,01 165,00                               | 2   | 0,08          | 208.681,90            | 0,13          | 0  | 0,00          | 0,00                | 0,00          | 2   | 0,08          | 208.681,90            | 0,13          | 161,023   | 161,023        |
| 170,01 175,00                               | 2   | 0,08          | 230.472,79            | 0,14          | 0  | 0,00          | 0,00                | 0,00          | 2   | 0,08          | 230.472,79            | 0,14          | 173,335   | 173,335        |
| 175,01 180,00                               | 1   | 0,04          | 57.851,61             | 0,04          | 0  | 0,00          | 0,00                | 0,00          | 1   | 0,04          | 57.851,61             | 0,04          | 176,012   | 176,012        |
| 180,01 185,00                               | 1   | 0,04          | 74.114,54             | 0,04          | 0  | 0,00          | 0,00                | 0,00          | 1   | 0,04          | 74.114,54             | 0,05          | 184,392   | 184,392        |
| 220,01 225,00                               | 1   | 0,04          | 113.584,92            | 0,07          | 1  | 0,45          | 649,93              | 0,03          | 1   | 0,04          | 112.934,99            | 0,07          | 221,737   | 220,469        |
| <b>Total :</b>                              | <b>2.536</b>  | <b>100,00</b> | <b>165.086.753,62</b> | <b>100,00</b> | <b>220</b>   | <b>100,00</b> | <b>2.377.959,40</b> | <b>100,00</b> | <b>2.519</b>  | <b>100,00</b> | <b>162.708.794,22</b> | <b>100,00</b> |   |                |
| <b>Media Ponderada / Weighted Average :</b> |   |               |                       |               |  |               |                     |               |   |               |                       |               | <b>56,860</b>   | <b>56,208</b>  |
| <b>Media Simple / Average :</b>             |   |               | <b>65.097,30</b>      |               |  |               | <b>10.808,91</b>    |               |   |               | <b>64.592,61</b>      |               | <b>40,523</b>   | <b>39,881</b>  |
| <b>Mínimo / Minimum :</b>                   |   |               | <b>11,76</b>          |               |  |               | <b>12,78</b>        |               |   |               | <b>11,76</b>          |               | <b>0,003</b>  | <b>0,003</b>   |
| <b>Máximo / Maximum :</b>                   |   |               | <b>554.547,90</b>     |               |  |               | <b>345.617,39</b>   |               |   |               | <b>554.547,90</b>     |               | <b>221,737</b>  | <b>220,469</b> |