

HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Análisis de morosidad: Tasa de morosidad +3 meses

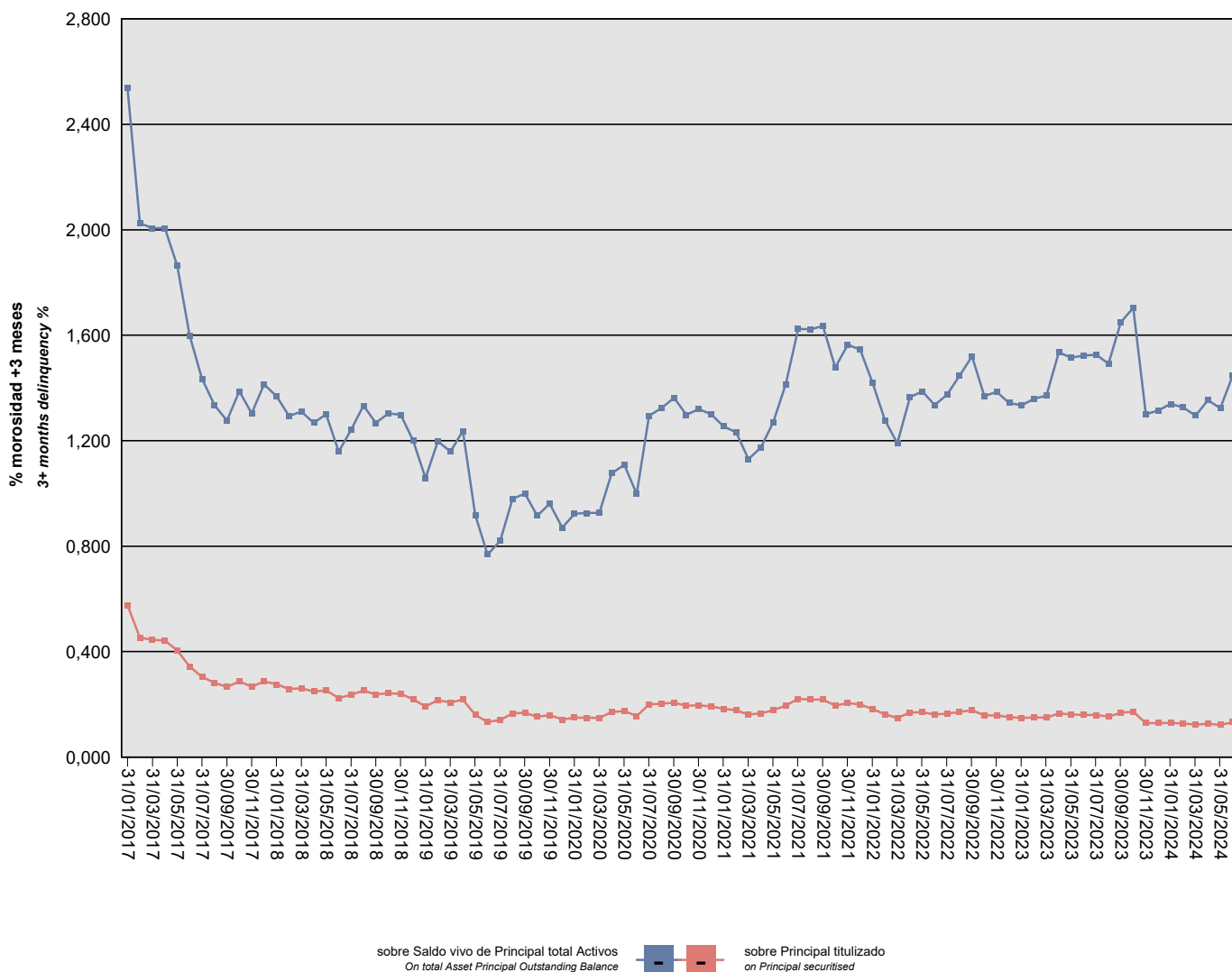
Delinquency analysis: 3+ months delinquency rate

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

Fecha / Date: 30/06/2024

Divisa / Currency: EUR

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad. La serie comienza en enero de 2017 debido a que, en ese mes, EdT se subrogó como administrador del fondo. / This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates. This series starts on January 2017 because, in that month, EdT took over as Servicer of the Fund



HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitized Assets

Análisis de morosidad: Tasa de morosidad +3 meses

Delinquency analysis: 3+ months delinquency rate

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

Fecha / Date: 30/06/2024

Divisa / Currency: EUR

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad. La serie comienza en enero de 2017 debido a que, en ese mes, EdT se subrogó como administrador del fondo. / This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections of the securitized assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates. This series starts on January 2017 because, in that month, EdT took over as Servicer of the Fund

Fecha Date	Saldo vivo de Activos en mora (Ppal. Miles €) Delinquent Asset Outstanding Balance (€ thou. Principal)	% morosidad +3 meses 3+ months delinquency %	
		sobre Saldo vivo de Principal total Activos On total Asset Principal Outstanding Balance	sobre Principal titulado on Principal securitised
31/01/2017	9.205,555	2,54%	0,58%
28/02/2017	7.245,532	2,02%	0,45%
31/03/2017	7.114,408	2,01%	0,44%
30/04/2017	7.063,052	2,01%	0,44%
31/05/2017	6.481,713	1,86%	0,41%
30/06/2017	5.498,768	1,60%	0,34%
31/07/2017	4.873,293	1,44%	0,30%
31/08/2017	4.492,547	1,33%	0,28%
30/09/2017	4.263,142	1,28%	0,27%
31/10/2017	4.593,117	1,39%	0,29%
30/11/2017	4.275,345	1,30%	0,27%
31/12/2017	4.595,266	1,41%	0,29%
31/01/2018	4.408,050	1,37%	0,28%
28/02/2018	4.136,685	1,29%	0,26%
31/03/2018	4.162,429	1,31%	0,26%
30/04/2018	3.980,204	1,27%	0,25%
31/05/2018	4.041,736	1,30%	0,25%
30/06/2018	3.573,116	1,16%	0,22%
31/07/2018	3.786,256	1,24%	0,24%
31/08/2018	4.036,779	1,33%	0,25%
30/09/2018	3.798,349	1,27%	0,24%
31/10/2018	3.878,809	1,30%	0,24%
30/11/2018	3.829,597	1,30%	0,24%
31/12/2018	3.508,219	1,20%	0,22%
31/01/2019	3.068,267	1,06%	0,19%
28/02/2019	3.446,748	1,20%	0,22%
31/03/2019	3.305,733	1,16%	0,21%
30/04/2019	3.492,958	1,24%	0,22%
31/05/2019	2.560,783	0,92%	0,16%
30/06/2019	2.121,594	0,77%	0,13%
31/07/2019	2.244,281	0,82%	0,14%
31/08/2019	2.657,105	0,98%	0,17%
30/09/2019	2.692,426	1,00%	0,17%
31/10/2019	2.445,579	0,92%	0,15%
30/11/2019	2.541,904	0,96%	0,16%
31/12/2019	2.276,960	0,87%	0,14%
31/01/2020	2.394,048	0,92%	0,15%
29/02/2020	2.384,761	0,93%	0,15%
31/03/2020	2.368,171	0,93%	0,15%

HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Análisis de morosidad: Tasa de morosidad +3 meses

Delinquency analysis: 3+ months delinquency rate

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

Fecha / Date: 30/06/2024

Divisa / Currency: EUR

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad. La serie comienza en enero de 2017 debido a que, en ese mes, EdT se subrogó como administrador del fondo. / This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates. This series starts on January 2017 because, in that month, EdT took over as Servicer of the Fund

Fecha Date	Saldo vivo de Activos en mora (Ppal. Miles €) Delinquent Asset Outstanding Balance (€ thou. Principal)	% morosidad +3 meses 3+ months delinquency %	
		sobre Saldo vivo de Principal total Activos On total Asset Principal Outstanding Balance	sobre Principal titulado on Principal securitised
30/04/2020	2.730,592	1,08%	0,17%
31/05/2020	2.787,496	1,11%	0,17%
30/06/2020	2.489,561	1,00%	0,16%
31/07/2020	3.198,606	1,30%	0,20%
31/08/2020	3.248,048	1,32%	0,20%
30/09/2020	3.299,871	1,36%	0,21%
31/10/2020	3.114,245	1,30%	0,19%
30/11/2020	3.136,878	1,32%	0,20%
31/12/2020	3.060,877	1,30%	0,19%
31/01/2021	2.924,872	1,25%	0,18%
28/02/2021	2.850,346	1,23%	0,18%
31/03/2021	2.582,944	1,13%	0,16%
30/04/2021	2.648,284	1,17%	0,17%
31/05/2021	2.837,963	1,27%	0,18%
30/06/2021	3.120,731	1,41%	0,20%
31/07/2021	3.535,343	1,62%	0,22%
31/08/2021	3.492,095	1,62%	0,22%
30/09/2021	3.491,335	1,64%	0,22%
31/10/2021	3.128,249	1,48%	0,20%
30/11/2021	3.277,419	1,56%	0,20%
31/12/2021	3.197,140	1,54%	0,20%
31/01/2022	2.910,382	1,42%	0,18%
28/02/2022	2.590,487	1,28%	0,16%
31/03/2022	2.379,233	1,19%	0,15%
30/04/2022	2.700,750	1,36%	0,17%
31/05/2022	2.718,486	1,39%	0,17%
30/06/2022	2.577,873	1,34%	0,16%
31/07/2022	2.625,489	1,37%	0,16%
31/08/2022	2.733,578	1,45%	0,17%
30/09/2022	2.834,779	1,52%	0,18%
31/10/2022	2.527,279	1,37%	0,16%
30/11/2022	2.526,332	1,39%	0,16%
31/12/2022	2.421,379	1,34%	0,15%
31/01/2023	2.377,828	1,33%	0,15%
28/02/2023	2.399,864	1,36%	0,15%
31/03/2023	2.391,939	1,37%	0,15%
30/04/2023	2.644,766	1,53%	0,17%
31/05/2023	2.577,752	1,52%	0,16%
30/06/2023	2.559,214	1,52%	0,16%

HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Análisis de morosidad: Tasa de morosidad +3 meses

Delinquency analysis: 3+ months delinquency rate

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

Fecha / Date: 30/06/2024

Divisa / Currency: EUR

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad. La serie comienza en enero de 2017 debido a que, en ese mes, EdT se subrogó como administrador del fondo. / This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates. This series starts on January 2017 because, in that month, EdT took over as Servicer of the Fund

Fecha Date	Saldo vivo de Activos en mora (Ppal. Miles €) Delinquent Asset Outstanding Balance (€ thou. Principal)	% morosidad +3 meses 3+ months delinquency %	
		sobre Saldo vivo de Principal total Activos On total Asset Principal Outstanding Balance	sobre Principal titulado on Principal securitised
31/07/2023	2.539,704	1,53%	0,16%
31/08/2023	2.457,785	1,49%	0,15%
30/09/2023	2.690,907	1,65%	0,17%
31/10/2023	2.748,345	1,70%	0,17%
30/11/2023	2.064,901	1,30%	0,13%
31/12/2023	2.062,559	1,31%	0,13%
31/01/2024	2.078,953	1,34%	0,13%
29/02/2024	2.034,322	1,33%	0,13%
31/03/2024	1.961,748	1,30%	0,12%
30/04/2024	2.019,078	1,35%	0,13%
31/05/2024	1.956,351	1,32%	0,12%
30/06/2024	2.113,747	1,45%	0,13%