

HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

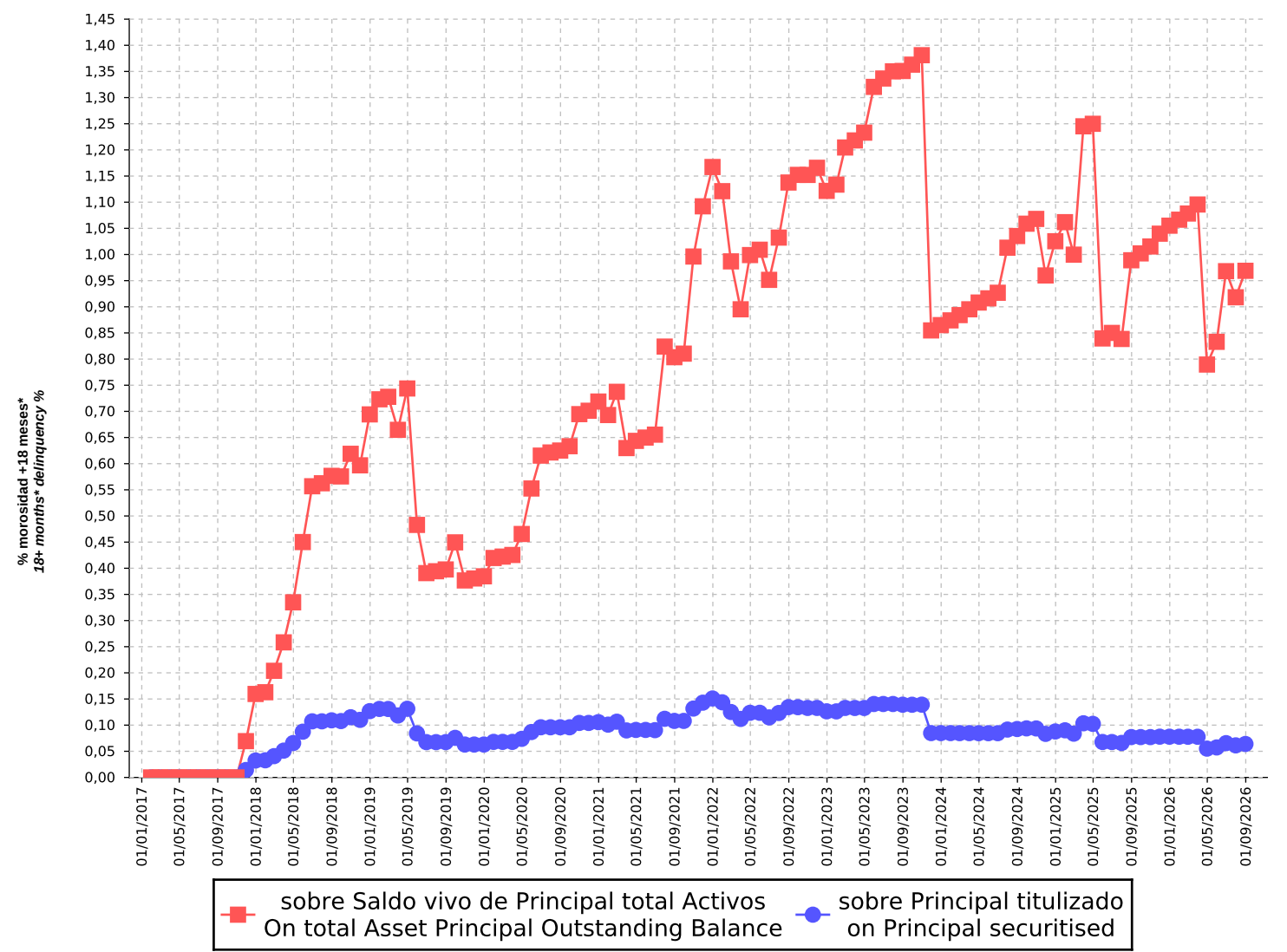
Análisis de Morosidad: Tasa de morosidad +18 meses*
Delinquency analysis: 18+ months* delinquency rate

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

Fecha / Date: 31/08/2026

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 / 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



HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Análisis de Morosidad: Tasa de morosidad +18 meses*
Delinquency analysis: 18+ months* delinquency rate

Activos / Assets: Préstamos hipotecarios vivienda (PHs/CTHs) / Residential mortgage loans (PTCs/MCs)
Fecha / Date: 31/08/2026
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 / 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

% morosidad +18 meses* 18+ months* delinquency %			
Fecha Date	Saldo vivo de Activos en mora *(ppal. Miles €) Delinquent *Asset Outstanding Balance (€ thou.)	Sobre Saldo vivo de Principal total Activos On total Asset Principal Outstanding Balance	Sobre Principal titulado on Principal securitised
31/01/2017	0,000	0,00 %	0,00 %
28/02/2017	0,000	0,00 %	0,00 %
31/03/2017	0,000	0,00 %	0,00 %
30/04/2017	0,000	0,00 %	0,00 %
31/05/2017	0,000	0,00 %	0,00 %
30/06/2017	0,000	0,00 %	0,00 %
31/07/2017	0,000	0,00 %	0,00 %
31/08/2017	0,000	0,00 %	0,00 %
30/09/2017	0,000	0,00 %	0,00 %
31/10/2017	0,000	0,00 %	0,00 %
30/11/2017	227,846	0,07 %	0,01 %
31/12/2017	518,793	0,16 %	0,03 %
31/01/2018	524,963	0,16 %	0,03 %
28/02/2018	651,958	0,20 %	0,04 %
31/03/2018	820,536	0,26 %	0,05 %
30/04/2018	1.050,876	0,33 %	0,07 %
31/05/2018	1.399,520	0,45 %	0,09 %
30/06/2018	1.717,162	0,56 %	0,11 %
31/07/2018	1.716,164	0,56 %	0,11 %
31/08/2018	1.746,815	0,58 %	0,11 %
30/09/2018	1.725,391	0,58 %	0,11 %
31/10/2018	1.841,347	0,62 %	0,12 %
30/11/2018	1.761,293	0,60 %	0,11 %
31/12/2018	2.028,718	0,69 %	0,13 %
31/01/2019	2.095,818	0,72 %	0,13 %
28/02/2019	2.094,875	0,73 %	0,13 %
31/03/2019	1.896,796	0,66 %	0,12 %
30/04/2019	2.100,773	0,74 %	0,13 %
31/05/2019	1.346,764	0,48 %	0,08 %
30/06/2019	1.079,231	0,39 %	0,07 %
31/07/2019	1.079,557	0,39 %	0,07 %

HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Análisis de Morosidad: Tasa de morosidad +18 meses*
Delinquency analysis: 18+ months* delinquency rate

Activos / Assets: Préstamos hipotecarios vivienda (PHs/CTHs) / Residential mortgage loans (PTCs/MCs)
Fecha / Date: 31/08/2026
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 / 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

% morosidad +18 meses* 18+ months* delinquency %			
Fecha Date	Saldo vivo de Activos en mora *(ppal. Miles €) Delinquent *Asset Outstanding Balance (€ thou.)	Sobre Saldo vivo de Principal total Activos On total Asset Principal Outstanding Balance	Sobre Principal titulado on Principal securitised
31/08/2019	1.079,241	0,40 %	0,07 %
30/09/2019	1.211,478	0,45 %	0,08 %
31/10/2019	1.006,231	0,38 %	0,06 %
30/11/2019	1.006,083	0,38 %	0,06 %
31/12/2019	1.006,610	0,38 %	0,06 %
31/01/2020	1.088,284	0,42 %	0,07 %
29/02/2020	1.088,037	0,42 %	0,07 %
31/03/2020	1.087,462	0,43 %	0,07 %
30/04/2020	1.181,209	0,47 %	0,07 %
31/05/2020	1.389,133	0,55 %	0,09 %
30/06/2020	1.535,116	0,62 %	0,10 %
31/07/2020	1.534,841	0,62 %	0,10 %
31/08/2020	1.534,840	0,63 %	0,10 %
30/09/2020	1.533,673	0,63 %	0,10 %
31/10/2020	1.667,234	0,69 %	0,10 %
30/11/2020	1.666,657	0,70 %	0,10 %
31/12/2020	1.691,845	0,72 %	0,11 %
31/01/2021	1.616,113	0,69 %	0,10 %
28/02/2021	1.706,094	0,74 %	0,11 %
31/03/2021	1.438,767	0,63 %	0,09 %
30/04/2021	1.452,664	0,64 %	0,09 %
31/05/2021	1.452,668	0,65 %	0,09 %
30/06/2021	1.446,080	0,66 %	0,09 %
31/07/2021	1.793,041	0,82 %	0,11 %
31/08/2021	1.730,365	0,80 %	0,11 %
30/09/2021	1.730,345	0,81 %	0,11 %
31/10/2021	2.107,282	1,00 %	0,13 %
30/11/2021	2.287,668	1,09 %	0,14 %
31/12/2021	2.415,981	1,17 %	0,15 %
31/01/2022	2.299,311	1,12 %	0,14 %
28/02/2022	2.001,214	0,99 %	0,13 %

HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Análisis de Morosidad: Tasa de morosidad +18 meses*
Delinquency analysis: 18+ months* delinquency rate

Activos / Assets: Préstamos hipotecarios vivienda (PHs/CTHs) / Residential mortgage loans (PTCs/MCs)
Fecha / Date: 31/08/2026
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 / 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

% morosidad +18 meses* 18+ months* delinquency %			
Fecha Date	Saldo vivo de Activos en mora *(ppal. Miles €) Delinquent *Asset Outstanding Balance (€ thou.)	Sobre Saldo vivo de Principal total Activos On total Asset Principal Outstanding Balance	Sobre Principal titulado on Principal securitised
31/03/2022	1.790,090	0,90 %	0,11 %
30/04/2022	1.977,610	1,00 %	0,12 %
31/05/2022	1.977,597	1,01 %	0,12 %
30/06/2022	1.837,022	0,95 %	0,11 %
31/07/2022	1.971,351	1,03 %	0,12 %
31/08/2022	2.150,654	1,14 %	0,13 %
30/09/2022	2.149,318	1,15 %	0,13 %
31/10/2022	2.126,907	1,15 %	0,13 %
30/11/2022	2.126,235	1,17 %	0,13 %
31/12/2022	2.021,750	1,12 %	0,13 %
31/01/2023	2.020,850	1,13 %	0,13 %
28/02/2023	2.125,931	1,20 %	0,13 %
31/03/2023	2.125,390	1,22 %	0,13 %
30/04/2023	2.125,385	1,23 %	0,13 %
31/05/2023	2.246,351	1,32 %	0,14 %
30/06/2023	2.246,687	1,34 %	0,14 %
31/07/2023	2.246,888	1,35 %	0,14 %
31/08/2023	2.225,584	1,35 %	0,14 %
30/09/2023	2.224,273	1,36 %	0,14 %
31/10/2023	2.227,634	1,38 %	0,14 %
30/11/2023	1.356,980	0,85 %	0,08 %
31/12/2023	1.356,480	0,86 %	0,08 %
31/01/2024	1.356,681	0,87 %	0,08 %
29/02/2024	1.355,662	0,88 %	0,08 %
31/03/2024	1.355,564	0,90 %	0,08 %
30/04/2024	1.353,951	0,91 %	0,08 %
31/05/2024	1.354,152	0,92 %	0,08 %
30/06/2024	1.353,903	0,93 %	0,08 %
31/07/2024	1.463,399	1,01 %	0,09 %
31/08/2024	1.481,963	1,04 %	0,09 %
30/09/2024	1.500,121	1,06 %	0,09 %

HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Análisis de Morosidad: Tasa de morosidad +18 meses*
Delinquency analysis: 18+ months* delinquency rate

Activos / Assets: Préstamos hipotecarios vivienda (PHs/CTHs) / Residential mortgage loans (PTCs/MCs)
Fecha / Date: 31/08/2026
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 / 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

% morosidad +18 meses* 18+ months* delinquency %			
Fecha Date	Saldo vivo de Activos en mora *(ppal. Miles €) Delinquent *Asset Outstanding Balance (€ thou.)	Sobre Saldo vivo de Principal total Activos On total Asset Principal Outstanding Balance	Sobre Principal titulado on Principal securitised
31/10/2024	1.498,801	1,07 %	0,09 %
30/11/2024	1.332,303	0,96 %	0,08 %
31/12/2024	1.406,201	1,03 %	0,09 %
31/01/2025	1.441,465	1,06 %	0,09 %
28/02/2025	1.339,993	1,00 %	0,08 %
31/03/2025	1.656,401	1,25 %	0,10 %
30/04/2025	1.638,959	1,25 %	0,10 %
31/05/2025	1.084,471	0,84 %	0,07 %
30/06/2025	1.083,359	0,85 %	0,07 %
31/07/2025	1.055,427	0,84 %	0,07 %
31/08/2025	1.234,851	0,99 %	0,08 %
30/09/2025	1.234,551	1,00 %	0,08 %
31/10/2025	1.234,151	1,02 %	0,08 %
30/11/2025	1.247,263	1,04 %	0,08 %
31/12/2025	1.246,275	1,06 %	0,08 %
31/01/2026	1.246,023	1,07 %	0,08 %
28/02/2026	1.245,317	1,08 %	0,08 %
31/03/2026	1.244,611	1,10 %	0,08 %
30/04/2026	881,408	0,79 %	0,06 %
31/05/2026	917,138	0,83 %	0,06 %
30/06/2026	1.048,810	0,97 %	0,07 %
31/07/2026	980,995	0,92 %	0,06 %
31/08/2026	1.023,467	0,97 %	0,06 %