

RURAL HIPOTECARIO XI Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Indices de Referencia / Distribution by Reference Indexes

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

Fecha / Date: 31/08/2023

Divisa / Currency: EUR

Indices de Referencia Reference Indexes	Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance				Principal Vencido Impagado Overdue Principal				Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal				Tipo Int. Int. Rate	Margen s/Indice Margin o/Index		
	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Med.Pond. W. Avg.	M.Pond. W. Avg.	Min.	Max.
Interés Variable Floating Interest	8.098	100,00	422.579.742,42	100,00	615	100,00	400.835,80	100,00	8.091	100,00	422.178.906,62	100,00	4,141%			
EURIBOR/MIBOR a 3 meses 3-month EURIBOR/MIBOR	1	0,01	6.359,14	0,00	0	0,00	0,00	0,00	1	0,01	6.359,14	0,00	3,100%	0,750	0,750	0,750
EURIBOR/MIBOR a 1 año 1-year EURIBOR/MIBOR	97	1,20	3.459.411,66	0,82	4	0,65	11.899,41	2,97	97	1,20	3.447.512,25	0,82	4,010%	0,956	0,400	2,000
EURIBOR/MIBOR a 1 año (M. Hipotecario) 1-year EURIBOR/MIBOR (Mortgage Market)	7.526	92,94	397.125.509,92	93,98	567	92,20	375.447,64	93,67	7.519	92,93	396.750.062,28	93,98	4,167%	0,856	-0,200	8,000
M. Hipotecario Conjunto de Entidades Mortgage Market: All Institutions	292	3,61	14.424.428,06	3,41	22	3,58	8.320,11	2,08	292	3,61	14.416.107,95	3,41	3,496%	0,232	0,000	2,000
M. Secundario Deuda Pública 2-6 años Secondary Market Public Debt 2-6 years	182	2,25	7.564.033,64	1,79	22	3,58	5.168,64	1,29	182	2,25	7.558.865,00	1,79	4,058%	1,636	0,000	2,331
Total :	8.098	100,00	422.579.742,42	100,00	615	100,00	400.835,80	100,00	8.091	100,00	422.178.906,62	100,00				
Media Ponderada / Weighted Average :													4,141%			
Media Simple / Average :			52.183,22				651,77				52.178,83		4,152%			
Mínimo / Minimum :			1,77				0,03				1,77		0,000%			
Máximo / Maximum :			311.903,17				36.483,38				311.903,17		7,362%			

Medias ponderadas por el principal pendiente de vencimiento / Averages weighted by the outstanding principal.

Tipo Interés: Tipo de interés nominal anual / Interest Rate: Annual nominal interest rate.