

## BBVA RMBS 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: 31/12/2019

Divisa / Currency: EUR

| Intervalos de Principal<br>Principal Intervals |            | Saldo Vivo de Principal<br>Outstanding Principal Balance |      |                  |      | Principal Vencido Impagado<br>Overdue Principal |      |                  |       | Principal Pendiente Vencimiento<br>Outstanding Principal |      |                  |      |
|------------------------------------------------|------------|----------------------------------------------------------|------|------------------|------|-------------------------------------------------|------|------------------|-------|----------------------------------------------------------|------|------------------|------|
|                                                |            | Num.                                                     | %    | Importe / Amount | %    | Num.                                            | %    | Importe / Amount | %     | Num.                                                     | %    | Importe / Amount | %    |
| 0,00                                           | 11.999,99  | 5                                                        | 0,07 | 28.441,48        | 0,00 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00  | 5                                                        | 0,07 | 28.441,48        | 0,00 |
| 12.000,00                                      | 23.999,99  | 33                                                       | 0,48 | 598.368,46       | 0,06 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00  | 33                                                       | 0,48 | 598.368,46       | 0,06 |
| 24.000,00                                      | 35.999,99  | 105                                                      | 1,53 | 3.206.345,76     | 0,34 | 5                                               | 1,30 | 1.957,77         | 0,08  | 105                                                      | 1,53 | 3.204.387,99     | 0,34 |
| 36.000,00                                      | 47.999,99  | 141                                                      | 2,06 | 6.011.993,18     | 0,64 | 11                                              | 2,86 | 10.614,76        | 0,42  | 141                                                      | 2,06 | 6.001.378,42     | 0,64 |
| 48.000,00                                      | 59.999,99  | 245                                                      | 3,57 | 13.271.911,23    | 1,41 | 15                                              | 3,91 | 66.797,28        | 2,66  | 244                                                      | 3,56 | 13.205.113,95    | 1,41 |
| 60.000,00                                      | 71.999,99  | 329                                                      | 4,80 | 21.834.236,22    | 2,32 | 22                                              | 5,73 | 86.891,19        | 3,46  | 328                                                      | 4,79 | 21.747.345,03    | 2,32 |
| 72.000,00                                      | 83.999,99  | 429                                                      | 6,25 | 33.559.018,32    | 3,57 | 32                                              | 8,33 | 100.563,62       | 4,00  | 428                                                      | 6,25 | 33.458.454,70    | 3,56 |
| 84.000,00                                      | 95.999,99  | 539                                                      | 7,86 | 48.646.081,31    | 5,17 | 30                                              | 7,81 | 117.057,23       | 4,66  | 538                                                      | 7,86 | 48.529.024,08    | 5,17 |
| 96.000,00                                      | 107.999,99 | 584                                                      | 8,51 | 59.595.989,65    | 6,33 | 22                                              | 5,73 | 11.244,80        | 0,45  | 584                                                      | 8,53 | 59.584.744,85    | 6,35 |
| 108.000,00                                     | 119.999,99 | 626                                                      | 9,13 | 71.554.063,19    | 7,60 | 32                                              | 8,33 | 250.470,04       | 9,97  | 624                                                      | 9,12 | 71.303.593,15    | 7,60 |
| 120.000,00                                     | 131.999,99 | 631                                                      | 9,20 | 79.555.090,51    | 8,45 | 29                                              | 7,55 | 287.131,57       | 11,43 | 629                                                      | 9,19 | 79.267.958,94    | 8,44 |
| 132.000,00                                     | 143.999,99 | 575                                                      | 8,38 | 79.262.587,14    | 8,42 | 35                                              | 9,11 | 194.874,13       | 7,76  | 574                                                      | 8,39 | 79.067.713,01    | 8,42 |
| 144.000,00                                     | 155.999,99 | 510                                                      | 7,43 | 76.399.635,69    | 8,12 | 35                                              | 9,11 | 318.087,27       | 12,66 | 508                                                      | 7,42 | 76.081.548,42    | 8,10 |
| 156.000,00                                     | 167.999,99 | 411                                                      | 5,99 | 66.470.523,28    | 7,06 | 22                                              | 5,73 | 15.556,93        | 0,62  | 411                                                      | 6,00 | 66.454.966,35    | 7,08 |
| 168.000,00                                     | 179.999,99 | 356                                                      | 5,19 | 61.827.582,12    | 6,57 | 26                                              | 6,77 | 38.295,67        | 1,52  | 356                                                      | 5,20 | 61.789.286,45    | 6,58 |
| 180.000,00                                     | 191.999,99 | 315                                                      | 4,59 | 58.504.224,95    | 6,22 | 16                                              | 4,17 | 201.973,52       | 8,04  | 314                                                      | 4,59 | 58.302.251,43    | 6,21 |
| 192.000,00                                     | 203.999,99 | 232                                                      | 3,38 | 45.820.729,21    | 4,87 | 18                                              | 4,69 | 36.401,75        | 1,45  | 232                                                      | 3,39 | 45.784.327,46    | 4,88 |
| 204.000,00                                     | 215.999,99 | 174                                                      | 2,54 | 36.525.532,03    | 3,88 | 7                                               | 1,82 | 5.115,96         | 0,20  | 174                                                      | 2,54 | 36.520.416,07    | 3,89 |
| 216.000,00                                     | 227.999,99 | 124                                                      | 1,81 | 27.482.870,18    | 2,92 | 5                                               | 1,30 | 228.196,92       | 9,09  | 123                                                      | 1,80 | 27.254.673,26    | 2,90 |
| 228.000,00                                     | 239.999,99 | 97                                                       | 1,41 | 22.698.348,31    | 2,41 | 3                                               | 0,78 | 3.031,59         | 0,12  | 97                                                       | 1,42 | 22.695.316,72    | 2,42 |
| 240.000,00                                     | 251.999,99 | 64                                                       | 0,93 | 15.716.706,82    | 1,67 | 2                                               | 0,52 | 250.602,73       | 9,98  | 63                                                       | 0,92 | 15.466.104,09    | 1,65 |
| 252.000,00                                     | 263.999,99 | 56                                                       | 0,82 | 14.431.818,94    | 1,53 | 2                                               | 0,52 | 258.229,26       | 10,28 | 55                                                       | 0,80 | 14.173.589,68    | 1,51 |
| 264.000,00                                     | 275.999,99 | 43                                                       | 0,63 | 11.615.288,04    | 1,23 | 2                                               | 0,52 | 6.266,93         | 0,25  | 43                                                       | 0,63 | 11.609.021,11    | 1,24 |
| 276.000,00                                     | 287.999,99 | 39                                                       | 0,57 | 11.001.353,43    | 1,17 | 3                                               | 0,78 | 2.478,22         | 0,10  | 39                                                       | 0,57 | 10.998.875,21    | 1,17 |
| 288.000,00                                     | 299.999,99 | 33                                                       | 0,48 | 9.691.867,17     | 1,03 | 1                                               | 0,26 | 708,27           | 0,03  | 33                                                       | 0,48 | 9.691.158,90     | 1,03 |
| 300.000,00                                     | 311.999,99 | 25                                                       | 0,36 | 7.635.512,65     | 0,81 | 1                                               | 0,26 | 774,87           | 0,03  | 25                                                       | 0,37 | 7.634.737,78     | 0,81 |
| 312.000,00                                     | 323.999,99 | 23                                                       | 0,34 | 7.299.233,96     | 0,78 | 1                                               | 0,26 | 788,54           | 0,03  | 23                                                       | 0,34 | 7.298.445,42     | 0,78 |
| 324.000,00                                     | 335.999,99 | 13                                                       | 0,19 | 4.294.921,06     | 0,46 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00  | 13                                                       | 0,19 | 4.294.921,06     | 0,46 |

## BBVA RMBS 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: 31/12/2019

Divisa / Currency: EUR

| Intervalos de Principal<br>Principal Intervals |            | Saldo Vivo de Principal<br>Outstanding Principal Balance |      |                  |      | Principal Vencido Impagado<br>Overdue Principal |      |                  |      | Principal Pendiente Vencimiento<br>Outstanding Principal |      |                  |      |
|------------------------------------------------|------------|----------------------------------------------------------|------|------------------|------|-------------------------------------------------|------|------------------|------|----------------------------------------------------------|------|------------------|------|
|                                                |            | Num.                                                     | %    | Importe / Amount | %    | Num.                                            | %    | Importe / Amount | %    | Num.                                                     | %    | Importe / Amount | %    |
| 336.000,00                                     | 347.999,99 | 10                                                       | 0,15 | 3.418.953,42     | 0,36 | 1                                               | 0,26 | 1.139,55         | 0,05 | 10                                                       | 0,15 | 3.417.813,87     | 0,36 |
| 348.000,00                                     | 359.999,99 | 15                                                       | 0,22 | 5.322.997,60     | 0,57 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 15                                                       | 0,22 | 5.322.997,60     | 0,57 |
| 360.000,00                                     | 371.999,99 | 11                                                       | 0,16 | 4.022.238,13     | 0,43 | 2                                               | 0,52 | 5.433,97         | 0,22 | 11                                                       | 0,16 | 4.016.804,16     | 0,43 |
| 372.000,00                                     | 383.999,99 | 10                                                       | 0,15 | 3.794.218,83     | 0,40 | 1                                               | 0,26 | 1.169,79         | 0,05 | 10                                                       | 0,15 | 3.793.049,04     | 0,40 |
| 384.000,00                                     | 395.999,99 | 1                                                        | 0,01 | 384.777,37       | 0,04 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 1                                                        | 0,01 | 384.777,37       | 0,04 |
| 396.000,00                                     | 407.999,99 | 7                                                        | 0,10 | 2.807.458,22     | 0,30 | 1                                               | 0,26 | 1.846,01         | 0,07 | 7                                                        | 0,10 | 2.805.612,21     | 0,30 |
| 408.000,00                                     | 419.999,99 | 6                                                        | 0,09 | 2.477.671,58     | 0,26 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 6                                                        | 0,09 | 2.477.671,58     | 0,26 |
| 420.000,00                                     | 431.999,99 | 2                                                        | 0,03 | 855.234,96       | 0,09 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 2                                                        | 0,03 | 855.234,96       | 0,09 |
| 432.000,00                                     | 443.999,99 | 2                                                        | 0,03 | 878.576,48       | 0,09 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 2                                                        | 0,03 | 878.576,48       | 0,09 |
| 444.000,00                                     | 455.999,99 | 4                                                        | 0,06 | 1.803.207,71     | 0,19 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 4                                                        | 0,06 | 1.803.207,71     | 0,19 |
| 456.000,00                                     | 467.999,99 | 4                                                        | 0,06 | 1.843.428,28     | 0,20 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 4                                                        | 0,06 | 1.843.428,28     | 0,20 |
| 468.000,00                                     | 479.999,99 | 3                                                        | 0,04 | 1.420.819,86     | 0,15 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 3                                                        | 0,04 | 1.420.819,86     | 0,15 |
| 480.000,00                                     | 491.999,99 | 1                                                        | 0,01 | 487.856,99       | 0,05 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 1                                                        | 0,01 | 487.856,99       | 0,05 |
| 492.000,00                                     | 503.999,99 | 2                                                        | 0,03 | 1.004.730,90     | 0,11 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 2                                                        | 0,03 | 1.004.730,90     | 0,11 |
| 504.000,00                                     | 515.999,99 | 1                                                        | 0,01 | 510.577,16       | 0,05 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 1                                                        | 0,01 | 510.577,16       | 0,05 |
| 516.000,00                                     | 527.999,99 | 2                                                        | 0,03 | 1.041.736,37     | 0,11 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 2                                                        | 0,03 | 1.041.736,37     | 0,11 |
| 540.000,00                                     | 551.999,99 | 1                                                        | 0,01 | 548.120,02       | 0,06 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 1                                                        | 0,01 | 548.120,02       | 0,06 |
| 552.000,00                                     | 563.999,99 | 1                                                        | 0,01 | 559.726,68       | 0,06 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 1                                                        | 0,01 | 559.726,68       | 0,06 |
| 564.000,00                                     | 575.999,99 | 1                                                        | 0,01 | 564.515,17       | 0,06 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 1                                                        | 0,01 | 564.515,17       | 0,06 |
| 576.000,00                                     | 587.999,99 | 4                                                        | 0,06 | 2.328.882,23     | 0,25 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 4                                                        | 0,06 | 2.328.882,23     | 0,25 |
| 588.000,00                                     | 599.999,99 | 3                                                        | 0,04 | 1.787.811,30     | 0,19 | 1                                               | 0,26 | 4.029,75         | 0,16 | 3                                                        | 0,04 | 1.783.781,55     | 0,19 |
| 600.000,00                                     | 611.999,99 | 1                                                        | 0,01 | 610.770,77       | 0,06 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 1                                                        | 0,01 | 610.770,77       | 0,07 |
| 624.000,00                                     | 635.999,99 | 1                                                        | 0,01 | 624.344,35       | 0,07 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 1                                                        | 0,01 | 624.344,35       | 0,07 |
| 636.000,00                                     | 647.999,99 | 1                                                        | 0,01 | 638.424,50       | 0,07 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 1                                                        | 0,01 | 638.424,50       | 0,07 |
| 648.000,00                                     | 659.999,99 | 1                                                        | 0,01 | 651.882,55       | 0,07 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 1                                                        | 0,01 | 651.882,55       | 0,07 |
| 660.000,00                                     | 671.999,99 | 1                                                        | 0,01 | 660.440,41       | 0,07 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 1                                                        | 0,01 | 660.440,41       | 0,07 |
| 684.000,00                                     | 695.999,99 | 1                                                        | 0,01 | 688.821,18       | 0,07 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 1                                                        | 0,01 | 688.821,18       | 0,07 |
| 708.000,00                                     | 719.999,99 | 1                                                        | 0,01 | 712.114,88       | 0,08 | 0                                               | 0,00 | 0,00             | 0,00 | 1                                                        | 0,01 | 712.114,88       | 0,08 |

## BBVA RMBS 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: 31/12/2019

Divisa / Currency: EUR

| Intervalos de Principal<br>Principal Intervals |              | Saldo Vivo de Principal<br>Outstanding Principal Balance |        |                  |        | Principal Vencido Impagado<br>Overdue Principal |        |                  |        | Principal Pendiente Vencimiento<br>Outstanding Principal |        |                  |        |
|------------------------------------------------|--------------|----------------------------------------------------------|--------|------------------|--------|-------------------------------------------------|--------|------------------|--------|----------------------------------------------------------|--------|------------------|--------|
|                                                |              | Num.                                                     | %      | Importe / Amount | %      | Num.                                            | %      | Importe / Amount | %      | Num.                                                     | %      | Importe / Amount | %      |
| 744.000,00                                     | 755.999,99   | 1                                                        | 0,01   | 750.141,75       | 0,08   | 0                                               | 0,00   | 0,00             | 0,00   | 1                                                        | 0,01   | 750.141,75       | 0,08   |
| 768.000,00                                     | 779.999,99   | 1                                                        | 0,01   | 775.054,16       | 0,08   | 0                                               | 0,00   | 0,00             | 0,00   | 1                                                        | 0,01   | 775.054,16       | 0,08   |
| 816.000,00                                     | 827.999,99   | 1                                                        | 0,01   | 817.263,04       | 0,09   | 0                                               | 0,00   | 0,00             | 0,00   | 1                                                        | 0,01   | 817.263,04       | 0,09   |
| 828.000,00                                     | 839.999,99   | 1                                                        | 0,01   | 830.383,55       | 0,09   | 0                                               | 0,00   | 0,00             | 0,00   | 1                                                        | 0,01   | 830.383,55       | 0,09   |
| 1.068.000,00                                   | 1.079.999,99 | 1                                                        | 0,01   | 1.079.292,09     | 0,11   | 1                                               | 0,26   | 4.008,40         | 0,16   | 1                                                        | 0,01   | 1.075.283,69     | 0,11   |
| Total :                                        |              | 6.860                                                    | 100,00 | 941.242.746,78   | 100,00 | 384                                             | 100,00 | 2.511.738,29     | 100,00 | 6.845                                                    | 100,00 | 938.731.008,49   | 100,00 |
| Media Ponderada / Weighted Average :           |              |                                                          |        |                  |        |                                                 |        |                  |        |                                                          |        |                  |        |
| Media Simple / Average :                       |              |                                                          |        | 137.207,40       |        |                                                 |        | 6.540,99         |        |                                                          |        | 137.141,13       |        |
| Mínimo / Minimum :                             |              |                                                          |        | 1.361,48         |        |                                                 |        | 58,42            |        |                                                          |        | 1.361,48         |        |
| Máximo / Maximum :                             |              |                                                          |        | 1.079.292,09     |        |                                                 |        | 257.497,60       |        |                                                          |        | 1.075.283,69     |        |