

BBVA RMBS 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Intervalos de Fecha de Vencimiento Final / Distribution by Final Maturity Date Intervals

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

Fecha / Date: 31/10/2017

Divisa / Currency: EUR

| Intervalos anuales Annual Intervals | Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance | | | | Principal Vencido Impagado Overdue Principal | | | | Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal | | | | Tipo Interés Interest Rate | Vida residual Residual Life |
|--|--|-------|------------------|-------|---|-------|------------------|-------|--|-------|------------------|-------|-------------------------------|----------------------------------|
| | Num. | % | Importe / Amount | % | Num. | % | Importe / Amount | % | Num. | % | Importe / Amount | % | Media POND. W. Average | M. POND. Meses W. Avg. Months |
| 2018 | 1 | 0,01 | 3.472,50 | 0,00 | 1 | 0,23 | 313,79 | 0,04 | 1 | 0,01 | 3.158,71 | 0,00 | 1,446% | 10,000 |
| 2019 | 1 | 0,01 | 7.577,83 | 0,00 | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1 | 0,01 | 7.577,83 | 0,00 | 1,081% | 16,000 |
| 2020 | 1 | 0,01 | 25.915,90 | 0,00 | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1 | 0,01 | 25.915,90 | 0,00 | 0,982% | 37,000 |
| 2021 | 5 | 0,07 | 227.173,59 | 0,02 | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5 | 0,07 | 227.173,59 | 0,02 | 0,731% | 47,178 |
| 2022 | 6 | 0,08 | 253.877,50 | 0,02 | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6 | 0,08 | 253.877,50 | 0,02 | 0,827% | 55,010 |
| 2023 | 12 | 0,17 | 617.310,45 | 0,06 | 1 | 0,23 | 9.322,16 | 1,31 | 12 | 0,17 | 607.988,29 | 0,06 | 1,217% | 68,636 |
| 2024 | 10 | 0,14 | 462.180,60 | 0,04 | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10 | 0,14 | 462.180,60 | 0,04 | 0,646% | 80,625 |
| 2025 | 17 | 0,23 | 958.001,52 | 0,09 | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 17 | 0,23 | 958.001,52 | 0,09 | 0,911% | 93,602 |
| 2026 | 19 | 0,26 | 903.131,72 | 0,08 | 1 | 0,23 | 451,76 | 0,06 | 19 | 0,26 | 902.679,96 | 0,08 | 1,162% | 106,212 |
| 2027 | 14 | 0,19 | 1.525.173,32 | 0,14 | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 14 | 0,19 | 1.525.173,32 | 0,14 | 0,831% | 116,317 |
| 2028 | 19 | 0,26 | 1.745.277,70 | 0,16 | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 19 | 0,26 | 1.745.277,70 | 0,16 | 0,565% | 128,769 |
| 2029 | 25 | 0,34 | 1.837.602,09 | 0,17 | 2 | 0,47 | 1.036,33 | 0,15 | 25 | 0,34 | 1.836.565,76 | 0,17 | 0,932% | 142,224 |
| 2030 | 44 | 0,61 | 3.934.755,95 | 0,36 | 3 | 0,70 | 783,82 | 0,11 | 44 | 0,61 | 3.933.972,13 | 0,36 | 0,758% | 153,406 |
| 2031 | 104 | 1,43 | 10.031.836,83 | 0,92 | 6 | 1,40 | 4.148,07 | 0,58 | 104 | 1,43 | 10.027.688,76 | 0,92 | 0,946% | 165,133 |
| 2032 | 35 | 0,48 | 3.493.738,03 | 0,32 | 1 | 0,23 | 2.448,80 | 0,34 | 35 | 0,48 | 3.491.289,23 | 0,32 | 0,728% | 176,196 |
| 2033 | 45 | 0,62 | 5.525.716,77 | 0,51 | 4 | 0,93 | 7.528,54 | 1,05 | 45 | 0,62 | 5.518.188,23 | 0,51 | 0,868% | 189,170 |
| 2034 | 102 | 1,40 | 12.071.502,91 | 1,11 | 6 | 1,40 | 14.244,44 | 2,00 | 102 | 1,40 | 12.057.258,47 | 1,11 | 0,658% | 201,490 |
| 2035 | 211 | 2,90 | 24.363.081,83 | 2,24 | 15 | 3,50 | 12.788,11 | 1,79 | 211 | 2,90 | 24.350.293,72 | 2,24 | 0,625% | 212,812 |
| 2036 | 283 | 3,89 | 30.588.969,13 | 2,82 | 17 | 3,96 | 37.789,30 | 5,29 | 283 | 3,89 | 30.551.179,83 | 2,81 | 0,898% | 224,303 |
| 2037 | 101 | 1,39 | 14.029.067,61 | 1,29 | 2 | 0,47 | 4.496,99 | 0,63 | 100 | 1,38 | 14.024.570,62 | 1,29 | 0,714% | 236,766 |
| 2038 | 104 | 1,43 | 13.760.940,17 | 1,27 | 6 | 1,40 | 5.760,47 | 0,81 | 104 | 1,43 | 13.755.179,70 | 1,27 | 0,666% | 248,016 |
| 2039 | 139 | 1,91 | 20.918.008,20 | 1,93 | 14 | 3,26 | 59.177,20 | 8,29 | 139 | 1,91 | 20.858.831,00 | 1,92 | 0,852% | 261,751 |
| 2040 | 339 | 4,66 | 46.480.651,03 | 4,28 | 21 | 4,90 | 40.797,89 | 5,72 | 339 | 4,66 | 46.439.853,14 | 4,28 | 0,622% | 273,411 |
| 2041 | 689 | 9,48 | 83.881.154,91 | 7,72 | 34 | 7,93 | 58.687,99 | 8,22 | 689 | 9,48 | 83.822.466,92 | 7,72 | 0,967% | 284,545 |
| 2042 | 138 | 1,90 | 22.664.662,36 | 2,09 | 6 | 1,40 | 18.861,14 | 2,64 | 138 | 1,90 | 22.645.801,22 | 2,09 | 0,755% | 296,204 |
| 2043 | 115 | 1,58 | 20.854.729,24 | 1,92 | 11 | 2,56 | 10.931,06 | 1,53 | 115 | 1,58 | 20.843.798,18 | 1,92 | 0,658% | 308,297 |
| 2044 | 171 | 2,35 | 27.845.689,69 | 2,56 | 9 | 2,10 | 9.256,68 | 1,30 | 171 | 2,35 | 27.836.433,01 | 2,56 | 0,702% | 321,029 |
| 2045 | 461 | 6,34 | 75.152.267,96 | 6,92 | 22 | 5,13 | 33.221,04 | 4,65 | 461 | 6,34 | 75.119.046,92 | 6,92 | 0,699% | 333,283 |
| 2046 | 910 | 12,52 | 144.142.443,02 | 13,27 | 56 | 13,05 | 107.374,05 | 15,04 | 910 | 12,52 | 144.035.068,97 | 13,26 | 0,853% | 344,446 |
| 2047 | 492 | 6,77 | 85.683.232,09 | 7,89 | 43 | 10,02 | 49.644,54 | 6,96 | 492 | 6,77 | 85.633.587,55 | 7,89 | 0,735% | 356,918 |

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.

BBVA RMBS 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / *Portfolio of Securitised Assets*

Distribución por Intervalos de Fecha de Vencimiento Final / *Distribution by Final Maturity Date Intervals*

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

Fecha / *Date*: 31/10/2017

Divisa / *Currency*: EUR

| Intervalos anuales <i>Annual Intervals</i> | Saldo Vivo de Principal <i>Outstanding Principal Balance</i> | | | | Principal Vencido Impagado <i>Overdue Principal</i> | | | | Principal Pendiente Vencimiento <i>Outstanding Principal</i> | | | | Tipo Interés <i>Interest Rate</i> | Vida residual <i>Residual Life</i> |
|--|---|---------------|-------------------------|---------------|--|---------------|-------------------------|---------------|---|---------------|-------------------------|---------------|--------------------------------------|---|
| | Num. | % | Importe / <i>Amount</i> | % | Num. | % | Importe / <i>Amount</i> | % | Num. | % | Importe / <i>Amount</i> | % | Media Pond. <i>W. Average</i> | M. Pond. Meses <i>W. Avg. Months</i> |
| 2048 | 334 | 4,59 | 60.347.751,18 | 5,55 | 28 | 6,53 | 82.810,52 | 11,60 | 334 | 4,59 | 60.264.940,66 | 5,55 | 0,724% | 367,542 |
| 2049 | 245 | 3,37 | 43.417.881,09 | 4,00 | 14 | 3,26 | 11.561,43 | 1,62 | 245 | 3,37 | 43.406.319,66 | 4,00 | 0,727% | 381,495 |
| 2050 | 585 | 8,05 | 101.720.302,33 | 9,36 | 30 | 6,99 | 63.176,16 | 8,85 | 585 | 8,05 | 101.657.126,17 | 9,36 | 0,637% | 394,036 |
| 2051 | 1.468 | 20,19 | 223.622.853,40 | 20,58 | 74 | 17,25 | 66.858,29 | 9,37 | 1.468 | 20,19 | 223.555.995,11 | 20,59 | 1,037% | 404,032 |
| 2052 | 26 | 0,36 | 3.470.212,11 | 0,32 | 2 | 0,47 | 311,51 | 0,04 | 26 | 0,36 | 3.469.900,60 | 0,32 | 1,542% | 410,921 |
| Total : | 7.271 | 100,00 | 1.086.568.142,56 | 100,00 | 429 | 100,00 | 713.782,08 | 100,00 | 7.270 | 100,00 | 1.085.854.360,48 | 100,00 | | |
| Media Ponderada / <i>Weighted Average</i> : | | | | | | | | | | | | | 0,820% | 336,946 |
| Media Simple / <i>Average</i> : | | | 149.438,61 | | | | 1.663,83 | | | | 149.360,98 | | 0,863% | 327,414 |
| Mínimo / <i>Minimum</i> : | | | 2.695,80 | | | | 61,40 | | | | 3.158,71 | | 0,094% | 31/08/2018 |
| Máximo / <i>Maximum</i> : | | | 1.183.460,50 | | | | 35.180,92 | | | | 1.179.432,69 | | 6,970% | 31/01/2052 |