

BBVA RMBS 21 Fondo de Titulización

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 (PHs/CTHs) / Residential mortgage loans (PTCs/MCs)
Fecha / Date: 31/08/2024
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 Interes 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
2023	1	0,00 %	32.065,97	0,00 %	1	0,02 %	32.065,97	0,45 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	0,000%	0,000
2024	158	0,16 %	429.643,02	0,00 %	4	0,09 %	24.092,84	0,33 %	155	0,16 %	405.550,18	0,00 %	4,472%	3,0443
2025	659	0,67 %	5.019.340,14	0,05 %	15	0,35 %	17.732,59	0,25 %	659	0,67 %	5.001.607,55	0,05 %	4,436%	11,8214
2026	792	0,80 %	11.419.756,89	0,12 %	24	0,55 %	16.710,72	0,23 %	792	0,80 %	11.403.046,17	0,12 %	4,461%	23,5503
2027	1.075	1,09 %	20.351.758,49	0,22 %	24	0,55 %	18.774,76	0,26 %	1.075	1,09 %	20.332.983,73	0,22 %	4,488%	34,741
2028	1.304	1,32 %	33.570.796,30	0,36 %	34	0,78 %	37.090,00	0,52 %	1.303	1,32 %	33.533.706,30	0,36 %	4,428%	46,860
2029	1.393	1,41 %	45.166.765,03	0,49 %	32	0,74 %	18.475,35	0,26 %	1.393	1,41 %	45.148.289,68	0,49 %	4,426%	58,8828
2030	1.703	1,72 %	62.568.577,99	0,68 %	49	1,13 %	32.992,13	0,46 %	1.703	1,72 %	62.535.585,86	0,68 %	4,381%	70,890
2031	2.040	2,06 %	88.980.807,95	0,96 %	66	1,52 %	31.181,23	0,43 %	2.040	2,06 %	88.949.626,72	0,96 %	4,173%	82,934
2032	2.131	2,15 %	99.221.487,47	1,07 %	74	1,70 %	39.744,05	0,55 %	2.131	2,15 %	99.181.743,42	1,07 %	4,424%	94,4488
2033	2.926	2,96 %	155.871.502,52	1,69 %	100	2,30 %	195.141,03	2,71 %	2.925	2,96 %	155.676.361,49	1,69 %	4,314%	106,7183
2034	2.995	3,03 %	176.096.174,97	1,91 %	93	2,14 %	50.429,21	0,70 %	2.995	3,03 %	176.045.745,76	1,91 %	4,336%	118,7325
2035	4.511	4,56 %	290.901.280,86	3,15 %	169	3,89 %	83.198,44	1,16 %	4.511	4,56 %	290.818.082,42	3,15 %	4,330%	130,7788
2036	5.912	5,97 %	434.758.468,60	4,71 %	230	5,29 %	168.093,05	2,34 %	5.912	5,98 %	434.590.375,55	4,71 %	4,032%	142,6896
2037	4.136	4,18 %	328.052.885,37	3,55 %	211	4,86 %	210.517,31	2,92 %	4.134	4,18 %	327.842.368,06	3,55 %	4,442%	154,1707
2038	4.026	4,07 %	329.706.892,11	3,57 %	196	4,51 %	232.607,06	3,23 %	4.025	4,07 %	329.474.285,05	3,57 %	4,334%	166,1662
2039	3.649	3,69 %	319.351.241,78	3,46 %	120	2,76 %	80.442,30	1,12 %	3.649	3,69 %	319.270.799,48	3,46 %	4,328%	178,8071
2040	5.112	5,17 %	463.679.533,32	5,02 %	146	3,36 %	356.749,92	4,96 %	5.110	5,17 %	463.322.783,40	5,02 %	4,293%	190,7142
2041	4.535	4,58 %	421.116.562,36	4,56 %	149	3,43 %	334.283,82	4,64 %	4.532	4,58 %	420.782.278,54	4,56 %	3,652%	202,7875
2042	2.733	2,76 %	275.932.256,84	2,99 %	123	2,83 %	181.024,01	2,51 %	2.732	2,76 %	275.751.232,83	2,99 %	4,564%	214,1435
2043	3.033	3,06 %	306.498.797,00	3,32 %	168	3,87 %	330.185,40	4,59 %	3.031	3,06 %	306.168.611,60	3,32 %	4,433%	226,3028
2044	2.782	2,81 %	299.800.278,81	3,25 %	118	2,72 %	311.004,53	4,32 %	2.779	2,81 %	299.489.274,28	3,25 %	4,340%	238,9024
2045	4.435	4,48 %	502.806.217,52	5,44 %	168	3,87 %	281.883,19	3,92 %	4.433	4,48 %	502.524.334,33	5,45 %	4,290%	250,8823
2046	6.755	6,83 %	799.052.188,89	8,65 %	280	6,45 %	699.754,53	9,72 %	6.750	6,82 %	798.352.434,36	8,65 %	3,512%	263,0819
2047	5.248	5,30 %	649.796.235,23	7,04 %	397	9,14 %	1.502.261,96	20,87 %	5.238	5,30 %	648.293.973,27	7,02 %	4,452%	273,795
2048	5.641	5,70 %	691.320.597,30	7,49 %	440	10,13 %	447.381,93	6,22 %	5.639	5,70 %	690.873.215,37	7,49 %	4,356%	285,560
2049	3.738	3,78 %	461.172.871,07	4,99 %	244	5,62 %	478.217,74	6,64 %	3.735	3,78 %	460.694.653,33	4,99 %	4,285%	298,8247
2050	6.169	6,23 %	773.869.850,39	8,38 %	278	6,40 %	325.565,28	4,52 %	6.167	6,23 %	773.544.285,11	8,38 %	4,261%	310,9042
2051	7.213	7,29 %	941.748.247,71	10,20 %	272	6,26 %	384.070,46	5,34 %	7.209	7,29 %	941.364.177,25	10,20 %	2,764%	321,5311
2052	1.094	1,11 %	122.259.973,56	1,32 %	59	1,36 %	19.259,11	0,27 %	1.094	1,11 %	122.240.714,45	1,32 %	5,219%	334,1199
2053	427	0,43 %	45.993.301,15	0,50 %	19	0,44 %	3.504,88	0,05 %	427	0,43 %	45.989.796,27	0,50 %	5,389%	346,4571
2054	183	0,18 %	19.877.930,34	0,22 %	8	0,18 %	243.826,48	3,39 %	182	0,18 %	19.634.103,86	0,21 %	5,303%	357,0095
2055	105	0,11 %	12.545.340,23	0,14 %	6	0,14 %	1.979,03	0,03 %	105	0,11 %	12.543.361,20	0,14 %	5,037%	369,9336

BBVA RMBS 21 Fondo de Titulización

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 (PHs/CTHs) / Residential mortgage loans (PTCs/MCs)
Fecha / Date: 31/08/2024
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 Interes 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	
2056	136	0,14 %	17.410.802,07	0,19 %	9	0,21 %	2.379,84	0,03 %	136	0,14 %	17.408.422,23	0,19 %	4,807%	383,3441	
2057	104	0,11 %	14.435.258,24	0,16 %	6	0,14 %	1.148,74	0,02 %	104	0,11 %	14.434.109,50	0,16 %	4,456%	393,4993	
2058	54	0,05 %	7.577.984,11	0,08 %	6	0,14 %	3.204,53	0,04 %	54	0,05 %	7.574.779,58	0,08 %	4,158%	405,8526	
2059	25	0,03 %	3.891.091,07	0,04 %	4	0,09 %	946,80	0,01 %	25	0,03 %	3.890.144,27	0,04 %	4,135%	416,5074	
2060	8	0,01 %	1.207.934,61	0,01 %	1	0,02 %	98,20	0,00 %	8	0,01 %	1.207.836,41	0,01 %	4,257%	427,9853	
2061	16	0,02 %	2.079.951,39	0,02 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	16	0,02 %	2.079.951,39	0,02 %	4,606%	441,8177	
2062	2	0,00 %	237.951,50	0,00 %	1	0,02 %	146,79	0,00 %	2	0,00 %	237.804,71	0,00 %	3,502%	449,4364	
2063	1	0,00 %	110.248,51	0,00 %	0	0,00 %	0,00	0,00 %	1	0,00 %	110.248,51	0,00 %	6,468%	461,000	
Total:	98.960	100,00	9.235.920.848,68	100,00	4.344	100,00	7.198.165,21	100,00	98.911	100,00	9.228.722.683,47	100,00			
Media Ponderada / Weighted Average :														4,090	236,085
Media simple / Average:			93.329,84				1.657,04				93.303,30		4,207	208,478	
Mínimo / Minimum :			2,21				0,06				2,21		0,187	30/09/2024	
Máximo / Maximum:			1.310.961,12				242.602,66				1.310.961,12		9,671	31/01/2063	