

# BBVA RMBS 22 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: 31/05/2024  
Divisa / Currency: EUR

| Intervalos anuales<br>Annual intervals | Saldo Vivo de Principal<br>Outstanding Principal Balance |         |                  |         | Principal Vencido Impagado<br>Overdue Principal |         |                  |         | Principal Pendiente Vencimiento<br>Outstanding Principal |         |                  |         | Tipo Interes<br>Interest Rate | Vida residual<br>Residual Life   |
|----------------------------------------|----------------------------------------------------------|---------|------------------|---------|-------------------------------------------------|---------|------------------|---------|----------------------------------------------------------|---------|------------------|---------|-------------------------------|----------------------------------|
|                                        | Num.                                                     | %       | Importe / Amount | %       | Num.                                            | %       | Importe / Amount | %       | Num.                                                     | %       | Importe / Amount | %       | Media Pond.<br>W. Average     | M. Pond. Meses<br>W. Avg. Months |
| 2024                                   | 1                                                        | 0,01 %  | 361,24           | 0,00 %  | 0                                               | 0,00 %  | 0,00             | 0,00 %  | 1                                                        | 0,01 %  | 361,24           | 0,00 %  | 5,822%                        | 1,000                            |
| 2025                                   | 2                                                        | 0,02 %  | 22.126,22        | 0,00 %  | 0                                               | 0,00 %  | 0,00             | 0,00 %  | 2                                                        | 0,02 %  | 22.126,22        | 0,00 %  | 4,361%                        | 13,8372                          |
| 2026                                   | 3                                                        | 0,03 %  | 55.015,67        | 0,00 %  | 0                                               | 0,00 %  | 0,00             | 0,00 %  | 3                                                        | 0,03 %  | 55.015,67        | 0,00 %  | 2,926%                        | 23,9994                          |
| 2027                                   | 11                                                       | 0,12 %  | 463.346,65       | 0,04 %  | 0                                               | 0,00 %  | 0,00             | 0,00 %  | 11                                                       | 0,12 %  | 463.346,65       | 0,04 %  | 2,867%                        | 39,0122                          |
| 2028                                   | 9                                                        | 0,10 %  | 403.197,22       | 0,03 %  | 0                                               | 0,00 %  | 0,00             | 0,00 %  | 9                                                        | 0,10 %  | 403.197,22       | 0,03 %  | 3,341%                        | 51,0033                          |
| 2029                                   | 7                                                        | 0,08 %  | 671.212,52       | 0,05 %  | 0                                               | 0,00 %  | 0,00             | 0,00 %  | 7                                                        | 0,08 %  | 671.212,52       | 0,05 %  | 3,537%                        | 62,2624                          |
| 2030                                   | 12                                                       | 0,13 %  | 581.408,93       | 0,05 %  | 0                                               | 0,00 %  | 0,00             | 0,00 %  | 12                                                       | 0,13 %  | 581.408,93       | 0,05 %  | 1,827%                        | 74,7925                          |
| 2031                                   | 37                                                       | 0,40 %  | 2.480.353,42     | 0,20 %  | 1                                               | 0,39 %  | 664,99           | 0,42 %  | 37                                                       | 0,40 %  | 2.479.688,43     | 0,20 %  | 2,199%                        | 87,8903                          |
| 2032                                   | 56                                                       | 0,61 %  | 4.516.736,63     | 0,36 %  | 0                                               | 0,00 %  | 0,00             | 0,00 %  | 56                                                       | 0,61 %  | 4.516.736,63     | 0,36 %  | 2,005%                        | 95,8303                          |
| 2033                                   | 47                                                       | 0,51 %  | 4.297.741,94     | 0,35 %  | 4                                               | 1,57 %  | 3.247,92         | 2,07 %  | 47                                                       | 0,51 %  | 4.294.494,02     | 0,35 %  | 2,482%                        | 110,6477                         |
| 2034                                   | 63                                                       | 0,69 %  | 5.346.840,56     | 0,43 %  | 0                                               | 0,00 %  | 0,00             | 0,00 %  | 63                                                       | 0,69 %  | 5.346.840,56     | 0,43 %  | 2,587%                        | 120,5027                         |
| 2035                                   | 103                                                      | 1,13 %  | 9.927.061,72     | 0,80 %  | 5                                               | 1,96 %  | 2.563,51         | 1,63 %  | 103                                                      | 1,13 %  | 9.924.498,21     | 0,80 %  | 2,872%                        | 134,0329                         |
| 2036                                   | 212                                                      | 2,32 %  | 22.451.662,73    | 1,80 %  | 13                                              | 5,10 %  | 5.952,43         | 3,79 %  | 212                                                      | 2,32 %  | 22.445.710,30    | 1,80 %  | 2,236%                        | 147,117                          |
| 2037                                   | 357                                                      | 3,90 %  | 37.438.410,60    | 3,01 %  | 9                                               | 3,53 %  | 14.346,10        | 9,13 %  | 357                                                      | 3,90 %  | 37.424.064,50    | 3,01 %  | 2,140%                        | 154,823                          |
| 2038                                   | 108                                                      | 1,18 %  | 12.055.629,92    | 0,97 %  | 8                                               | 3,14 %  | 3.564,82         | 2,27 %  | 108                                                      | 1,18 %  | 12.052.065,10    | 0,97 %  | 2,805%                        | 169,8453                         |
| 2039                                   | 130                                                      | 1,42 %  | 13.516.362,17    | 1,09 %  | 7                                               | 2,75 %  | 4.051,64         | 2,58 %  | 130                                                      | 1,42 %  | 13.512.310,53    | 1,09 %  | 2,900%                        | 180,9733                         |
| 2040                                   | 129                                                      | 1,41 %  | 13.478.078,56    | 1,08 %  | 4                                               | 1,57 %  | 1.675,45         | 1,07 %  | 129                                                      | 1,41 %  | 13.476.403,11    | 1,08 %  | 2,644%                        | 193,3549                         |
| 2041                                   | 353                                                      | 3,86 %  | 40.462.925,72    | 3,25 %  | 6                                               | 2,35 %  | 3.265,43         | 2,08 %  | 353                                                      | 3,86 %  | 40.459.660,29    | 3,25 %  | 1,929%                        | 208,3487                         |
| 2042                                   | 689                                                      | 7,53 %  | 85.764.110,82    | 6,89 %  | 21                                              | 8,24 %  | 12.440,96        | 7,92 %  | 689                                                      | 7,53 %  | 85.751.669,86    | 6,89 %  | 1,911%                        | 214,4464                         |
| 2043                                   | 156                                                      | 1,71 %  | 19.655.303,01    | 1,58 %  | 2                                               | 0,78 %  | 2.060,80         | 1,31 %  | 156                                                      | 1,71 %  | 19.653.242,21    | 1,58 %  | 2,626%                        | 229,9673                         |
| 2044                                   | 170                                                      | 1,86 %  | 22.460.773,40    | 1,81 %  | 4                                               | 1,57 %  | 4.076,35         | 2,59 %  | 170                                                      | 1,86 %  | 22.456.697,05    | 1,81 %  | 2,581%                        | 241,7508                         |
| 2045                                   | 237                                                      | 2,59 %  | 30.219.774,51    | 2,43 %  | 8                                               | 3,14 %  | 3.460,56         | 2,20 %  | 237                                                      | 2,59 %  | 30.216.313,95    | 2,43 %  | 2,598%                        | 253,5144                         |
| 2046                                   | 709                                                      | 7,75 %  | 97.759.564,51    | 7,86 %  | 20                                              | 7,84 %  | 16.691,49        | 10,62 % | 709                                                      | 7,75 %  | 97.742.873,02    | 7,86 %  | 1,950%                        | 268,4629                         |
| 2047                                   | 1.206                                                    | 13,19 % | 167.560.301,53   | 13,47 % | 26                                              | 10,20 % | 31.330,03        | 19,93 % | 1.206                                                    | 13,19 % | 167.528.971,50   | 13,47 % | 1,888%                        | 274,2919                         |
| 2048                                   | 231                                                      | 2,53 %  | 34.465.753,76    | 2,77 %  | 12                                              | 4,71 %  | 7.734,81         | 4,92 %  | 231                                                      | 2,53 %  | 34.458.018,95    | 2,77 %  | 3,208%                        | 289,4637                         |
| 2049                                   | 224                                                      | 2,45 %  | 36.228.566,97    | 2,91 %  | 18                                              | 7,06 %  | 10.061,04        | 6,40 %  | 224                                                      | 2,45 %  | 36.218.505,93    | 2,91 %  | 2,547%                        | 301,5573                         |
| 2050                                   | 294                                                      | 3,21 %  | 45.267.359,68    | 3,64 %  | 14                                              | 5,49 %  | 7.294,04         | 4,64 %  | 294                                                      | 3,21 %  | 45.260.065,64    | 3,64 %  | 2,549%                        | 313,3138                         |
| 2051                                   | 1.578                                                    | 17,25 % | 242.911.403,86   | 19,53 % | 21                                              | 8,24 %  | 7.609,29         | 4,84 %  | 1.578                                                    | 17,25 % | 242.903.794,57   | 19,53 % | 1,459%                        | 329,3233                         |
| 2052                                   | 1.945                                                    | 21,27 % | 284.115.356,68   | 22,84 % | 44                                              | 17,25 % | 13.863,02        | 8,82 %  | 1.945                                                    | 21,27 % | 284.101.493,66   | 22,84 % | 1,816%                        | 333,4009                         |
| 2053                                   | 25                                                       | 0,27 %  | 3.312.989,90     | 0,27 %  | 6                                               | 2,35 %  | 971,61           | 0,62 %  | 25                                                       | 0,27 %  | 3.312.018,29     | 0,27 %  | 4,302%                        | 348,5601                         |
| 2054                                   | 9                                                        | 0,10 %  | 1.375.258,46     | 0,11 %  | 1                                               | 0,39 %  | 186,67           | 0,12 %  | 9                                                        | 0,10 %  | 1.375.071,79     | 0,11 %  | 5,284%                        | 361,5984                         |
| 2055                                   | 2                                                        | 0,02 %  | 334.389,24       | 0,03 %  | 0                                               | 0,00 %  | 0,00             | 0,00 %  | 2                                                        | 0,02 %  | 334.389,24       | 0,03 %  | 5,137%                        | 374,4707                         |
| 2056                                   | 5                                                        | 0,05 %  | 693.934,27       | 0,06 %  | 0                                               | 0,00 %  | 0,00             | 0,00 %  | 5                                                        | 0,05 %  | 693.934,27       | 0,06 %  | 4,419%                        | 387,0232                         |

# BBVA RMBS 22 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: 31/05/2024  
Divisa / Currency: EUR

| Intervalos anuales<br>Annual intervals | Saldo Vivo de Principal<br>Outstanding Principal Balance |        |                  |        | Principal Vencido Impagado<br>Overdue Principal |        |                  |        | Principal Pendiente Vencimiento<br>Outstanding Principal |        |                  |        | Tipo Interes<br>Interest Rate | Vida residual<br>Residual Life   |         |
|----------------------------------------|----------------------------------------------------------|--------|------------------|--------|-------------------------------------------------|--------|------------------|--------|----------------------------------------------------------|--------|------------------|--------|-------------------------------|----------------------------------|---------|
|                                        | Num.                                                     | %      | Importe / Amount | %      | Num.                                            | %      | Importe / Amount | %      | Num.                                                     | %      | Importe / Amount | %      | Media Pond.<br>W. Average     | M. Pond. Meses<br>W. Avg. Months |         |
| 2057                                   | 11                                                       | 0,12 % | 1.494.210,88     | 0,12 % | 1                                               | 0,39 % | 61,61            | 0,04 % | 11                                                       | 0,12 % | 1.494.149,27     | 0,12 % | 4,178%                        | 396,7717                         |         |
| 2058                                   | 2                                                        | 0,02 % | 280.802,56       | 0,02 % | 0                                               | 0,00 % | 0,00             | 0,00 % | 2                                                        | 0,02 % | 280.802,56       | 0,02 % | 4,279%                        | 408,091                          |         |
| 2059                                   | 3                                                        | 0,03 % | 509.750,65       | 0,04 % | 0                                               | 0,00 % | 0,00             | 0,00 % | 3                                                        | 0,03 % | 509.750,65       | 0,04 % | 4,634%                        | 419,3472                         |         |
| 2060                                   | 3                                                        | 0,03 % | 513.212,26       | 0,04 % | 0                                               | 0,00 % | 0,00             | 0,00 % | 3                                                        | 0,03 % | 513.212,26       | 0,04 % | 5,227%                        | 434,5267                         |         |
| 2061                                   | 1                                                        | 0,01 % | 239.394,37       | 0,02 % | 0                                               | 0,00 % | 0,00             | 0,00 % | 1                                                        | 0,01 % | 239.394,37       | 0,02 % | 4,718%                        | 450,000                          |         |
| 2062                                   | 6                                                        | 0,07 % | 772.438,69       | 0,06 % | 0                                               | 0,00 % | 0,00             | 0,00 % | 6                                                        | 0,07 % | 772.438,69       | 0,06 % | 4,373%                        | 454,5543                         |         |
| Total:                                 | 9.146                                                    | 100,00 | 1.244.103.122,43 | 100,00 | 255                                             | 100,00 | 157.174,57       | 100,00 | 9.146                                                    | 100,00 | 1.243.945.947,86 | 100,00 |                               |                                  |         |
| Media Ponderada / Weighted Average :   |                                                          |        |                  |        |                                                 |        |                  |        |                                                          |        |                  |        |                               | 1,995                            | 280,944 |
| Media simple / Average:                |                                                          |        | 136.027,02       |        |                                                 |        | 616,37           |        |                                                          |        | 136.009,83       |        | 2,131                         | 272,335                          |         |
| Mínimo / Minimum :                     |                                                          |        | 361,24           |        |                                                 |        | 13,16            |        |                                                          |        | 361,24           |        | 0,500                         | 30/06/2024                       |         |
| Máximo / Maximum:                      |                                                          |        | 1.470.720,53     |        |                                                 |        | 22.845,45        |        |                                                          |        | 1.470.720,53     |        | 8,268                         | 31/05/2062                       |         |