

BBVA RMBS 23 Fondo de Titulización

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Intervalos de Principal / Distribution by Principal Intervals

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

Fecha / Date: 30/06/2024

Divisa / Currency: EUR

Intervalos de Principal Principal Intervals		Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance				Principal Vencido Impagado Overdue Principal				Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal			
		Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%
0,00	11.999,99	1	0,00	9.154,00	0,00	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	9.154,00	0,00
12.000,00	23.999,99	1	0,00	12.914,80	0,00	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	12.914,80	0,00
24.000,00	35.999,99	984	2,04	32.459.810,73	0,60	42	4,24	7.089,18	2,78	984	2,04	32.452.721,55	0,60
36.000,00	47.999,99	2.974	6,16	126.125.812,40	2,33	61	6,16	9.786,83	3,83	2.974	6,16	126.116.025,57	2,33
48.000,00	59.999,99	4.276	8,85	231.801.698,72	4,28	92	9,28	16.857,37	6,60	4.276	8,85	231.784.841,35	4,28
60.000,00	71.999,99	4.818	9,97	318.119.475,33	5,87	92	9,28	18.730,54	7,34	4.818	9,97	318.100.744,79	5,87
72.000,00	83.999,99	5.032	10,42	392.747.100,71	7,25	126	12,71	26.866,47	10,52	5.032	10,42	392.720.234,24	7,25
84.000,00	95.999,99	4.830	10,00	434.158.421,32	8,01	103	10,39	27.197,71	10,65	4.830	10,00	434.131.223,61	8,01
96.000,00	107.999,99	4.841	10,02	492.671.828,34	9,09	92	9,28	23.330,32	9,14	4.841	10,02	492.648.498,02	9,09
108.000,00	119.999,99	4.002	8,28	455.977.595,72	8,41	70	7,06	18.041,60	7,07	4.002	8,28	455.959.554,12	8,41
120.000,00	131.999,99	3.367	6,97	423.635.164,69	7,82	77	7,77	21.210,15	8,31	3.367	6,97	423.613.954,54	7,82
132.000,00	143.999,99	2.755	5,70	379.239.103,37	7,00	61	6,16	18.426,11	7,22	2.755	5,70	379.220.677,26	7,00
144.000,00	155.999,99	2.096	4,34	313.910.048,83	5,79	41	4,14	11.678,24	4,57	2.096	4,34	313.898.370,59	5,79
156.000,00	167.999,99	1.717	3,55	277.828.203,58	5,13	33	3,33	11.663,96	4,57	1.717	3,55	277.816.539,62	5,13
168.000,00	179.999,99	1.334	2,76	231.806.194,08	4,28	23	2,32	7.169,70	2,81	1.334	2,76	231.799.024,38	4,28
180.000,00	191.999,99	973	2,01	180.758.038,12	3,34	19	1,92	6.119,52	2,40	973	2,01	180.751.918,60	3,34
192.000,00	203.999,99	833	1,72	164.542.834,81	3,04	17	1,72	6.504,67	2,55	833	1,72	164.536.330,14	3,04
204.000,00	215.999,99	642	1,33	134.663.736,41	2,49	11	1,11	6.462,54	2,53	642	1,33	134.657.273,87	2,49
216.000,00	227.999,99	497	1,03	110.341.197,64	2,04	7	0,71	3.473,78	1,36	497	1,03	110.337.723,86	2,04
228.000,00	239.999,99	406	0,84	94.935.086,68	1,75	5	0,50	2.175,60	0,85	406	0,84	94.932.911,08	1,75
240.000,00	251.999,99	364	0,75	89.475.798,08	1,65	5	0,50	3.174,25	1,24	364	0,75	89.472.623,83	1,65
252.000,00	263.999,99	233	0,48	60.051.789,45	1,11	2	0,20	1.018,50	0,40	233	0,48	60.050.770,95	1,11
264.000,00	275.999,99	210	0,43	56.653.415,91	1,05	1	0,10	354,19	0,14	210	0,43	56.653.061,72	1,05
276.000,00	287.999,99	164	0,34	46.310.731,45	0,85	0	0,00	0,00	0,00	164	0,34	46.310.731,45	0,85
288.000,00	299.999,99	161	0,33	47.299.260,62	0,87	2	0,20	779,83	0,31	161	0,33	47.298.480,79	0,87
300.000,00	311.999,99	118	0,24	36.053.163,56	0,67	3	0,30	1.419,29	0,56	118	0,24	36.051.744,27	0,67
312.000,00	323.999,99	96	0,20	30.498.156,42	0,56	1	0,10	478,74	0,19	96	0,20	30.497.677,68	0,56
324.000,00	335.999,99	82	0,17	27.043.595,22	0,50	2	0,20	2.730,18	1,07	82	0,17	27.040.865,04	0,50

BBVA RMBS 23 Fondo de Titulización

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Intervalos de Principal / Distribution by Principal Intervals

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

Fecha / Date: 30/06/2024

Divisa / Currency: EUR

Intervalos de Principal Principal Intervals		Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance				Principal Vencido Impagado Overdue Principal				Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal			
		Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%
336.000,00	347.999,99	70	0,14	23.905.914,79	0,44	0	0,00	0,00	0,00	70	0,14	23.905.914,79	0,44
348.000,00	359.999,99	45	0,09	15.902.339,32	0,29	0	0,00	0,00	0,00	45	0,09	15.902.339,32	0,29
360.000,00	371.999,99	58	0,12	21.243.096,35	0,39	0	0,00	0,00	0,00	58	0,12	21.243.096,35	0,39
372.000,00	383.999,99	33	0,07	12.416.431,16	0,23	2	0,20	1.094,87	0,43	33	0,07	12.415.336,29	0,23
384.000,00	395.999,99	36	0,07	14.042.038,82	0,26	0	0,00	0,00	0,00	36	0,07	14.042.038,82	0,26
396.000,00	407.999,99	29	0,06	11.666.516,87	0,22	0	0,00	0,00	0,00	29	0,06	11.666.516,87	0,22
408.000,00	419.999,99	29	0,06	12.025.292,66	0,22	0	0,00	0,00	0,00	29	0,06	12.025.292,66	0,22
420.000,00	431.999,99	22	0,05	9.365.379,33	0,17	0	0,00	0,00	0,00	22	0,05	9.365.379,33	0,17
432.000,00	443.999,99	19	0,04	8.308.788,42	0,15	0	0,00	0,00	0,00	19	0,04	8.308.788,42	0,15
444.000,00	455.999,99	13	0,03	5.841.487,57	0,11	0	0,00	0,00	0,00	13	0,03	5.841.487,57	0,11
456.000,00	467.999,99	11	0,02	5.075.102,55	0,09	0	0,00	0,00	0,00	11	0,02	5.075.102,55	0,09
468.000,00	479.999,99	8	0,02	3.788.249,72	0,07	0	0,00	0,00	0,00	8	0,02	3.788.249,72	0,07
480.000,00	491.999,99	16	0,03	7.751.881,57	0,14	0	0,00	0,00	0,00	16	0,03	7.751.881,57	0,14
492.000,00	503.999,99	11	0,02	5.465.716,21	0,10	0	0,00	0,00	0,00	11	0,02	5.465.716,21	0,10
504.000,00	515.999,99	5	0,01	2.554.575,63	0,05	0	0,00	0,00	0,00	5	0,01	2.554.575,63	0,05
516.000,00	527.999,99	5	0,01	2.615.200,96	0,05	0	0,00	0,00	0,00	5	0,01	2.615.200,96	0,05
528.000,00	539.999,99	8	0,02	4.281.315,85	0,08	0	0,00	0,00	0,00	8	0,02	4.281.315,85	0,08
540.000,00	551.999,99	5	0,01	2.722.364,18	0,05	0	0,00	0,00	0,00	5	0,01	2.722.364,18	0,05
552.000,00	563.999,99	9	0,02	5.029.036,02	0,09	0	0,00	0,00	0,00	9	0,02	5.029.036,02	0,09
564.000,00	575.999,99	3	0,01	1.712.422,45	0,03	0	0,00	0,00	0,00	3	0,01	1.712.422,45	0,03
576.000,00	587.999,99	5	0,01	2.913.675,05	0,05	0	0,00	0,00	0,00	5	0,01	2.913.675,05	0,05
588.000,00	599.999,99	1	0,00	591.715,58	0,01	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	591.715,58	0,01
600.000,00	611.999,99	3	0,01	1.820.459,02	0,03	0	0,00	0,00	0,00	3	0,01	1.820.459,02	0,03
612.000,00	623.999,99	3	0,01	1.857.063,30	0,03	0	0,00	0,00	0,00	3	0,01	1.857.063,30	0,03
624.000,00	635.999,99	1	0,00	624.222,50	0,01	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	624.222,50	0,01
636.000,00	647.999,99	4	0,01	2.572.943,73	0,05	0	0,00	0,00	0,00	4	0,01	2.572.943,73	0,05
648.000,00	659.999,99	2	0,00	1.304.477,15	0,02	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.304.477,15	0,02
660.000,00	671.999,99	4	0,01	2.656.857,73	0,05	0	0,00	0,00	0,00	4	0,01	2.656.857,73	0,05

BBVA RMBS 23 Fondo de Titulización

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Intervalos de Principal / Distribution by Principal Intervals

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

Fecha / Date: 30/06/2024

Divisa / Currency: EUR

Intervalos de Principal Principal Intervals		Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance				Principal Vencido Impagado Overdue Principal				Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal			
		Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%
672.000,00	683.999,99	2	0,00	1.361.588,47	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.361.588,47	0,03
684.000,00	695.999,99	2	0,00	1.386.310,85	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.386.310,85	0,03
696.000,00	707.999,99	2	0,00	1.407.072,04	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.407.072,04	0,03
708.000,00	719.999,99	2	0,00	1.429.654,94	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.429.654,94	0,03
732.000,00	743.999,99	2	0,00	1.473.270,87	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.473.270,87	0,03
744.000,00	755.999,99	2	0,00	1.510.453,03	0,03	1	0,10	1.433,75	0,56	2	0,00	1.509.019,28	0,03
756.000,00	767.999,99	5	0,01	3.818.572,36	0,07	0	0,00	0,00	0,00	5	0,01	3.818.572,36	0,07
768.000,00	779.999,99	2	0,00	1.545.904,44	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.545.904,44	0,03
792.000,00	803.999,99	1	0,00	801.067,89	0,01	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	801.067,89	0,01
804.000,00	815.999,99	3	0,01	2.437.491,26	0,04	0	0,00	0,00	0,00	3	0,01	2.437.491,26	0,04
828.000,00	839.999,99	1	0,00	833.988,40	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	833.988,40	0,02
852.000,00	863.999,99	1	0,00	854.716,14	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	854.716,14	0,02
888.000,00	899.999,99	1	0,00	896.706,08	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	896.706,08	0,02
924.000,00	935.999,99	2	0,00	1.856.379,52	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.856.379,52	0,03
936.000,00	947.999,99	1	0,00	941.762,47	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	941.762,47	0,02
972.000,00	983.999,99	1	0,00	979.697,06	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	979.697,06	0,02
984.000,00	995.999,99	1	0,00	986.353,72	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	986.353,72	0,02
996.000,00	1.007.999,99	1	0,00	1.003.534,38	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.003.534,38	0,02
1.008.000,00	1.019.999,99	1	0,00	1.011.821,38	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.011.821,38	0,02
1.056.000,00	1.067.999,99	1	0,00	1.057.176,75	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.057.176,75	0,02
1.068.000,00	1.079.999,99	1	0,00	1.069.444,08	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.069.444,08	0,02
1.080.000,00	1.091.999,99	1	0,00	1.084.054,07	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.084.054,07	0,02
1.104.000,00	1.115.999,99	1	0,00	1.105.687,31	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.105.687,31	0,02
1.140.000,00	1.151.999,99	1	0,00	1.149.986,94	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.149.986,94	0,02
1.152.000,00	1.163.999,99	1	0,00	1.154.634,14	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.154.634,14	0,02
1.272.000,00	1.283.999,99	1	0,00	1.281.437,77	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.281.437,77	0,02
1.620.000,00	1.631.999,99	1	0,00	1.629.732,08	0,03	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.629.732,08	0,03
1.632.000,00	1.643.999,99	1	0,00	1.635.760,24	0,03	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.635.760,24	0,03

BBVA RMBS 23 Fondo de Titulización

Cartera de Activos Titulizados / *Portfolio of Securitised Assets*

Distribución por Intervalos de Principal / *Distribution by Principal Intervals*

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

Fecha / *Date*: 30/06/2024

Divisa / *Currency*: EUR

Intervalos de Principal <i>Principal 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>			
		Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%	Num.	%	Importe / <i>Amount</i>	%
1.872.000,00	1.883.999,99	1	0,00	1.878.239,25	0,03	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.878.239,25	0,03
Total :		48.308	100,00	5.418.766.393,41	100,00	991	100,00	255.267,89	100,00	48.308	100,00	5.418.511.125,52	100,00
Media Ponderada / <i>Weighted Average</i> :													
Media Simple / <i>Average</i> :		112.171,20				257,59				112.165,92			
Mínimo / <i>Minimum</i> :		9.154,00				37,14				9.154,00			
Máximo / <i>Maximum</i> :		1.878.239,25				1.815,11				1.878.239,25			