

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: 30/09/2024

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	8	0,02	62.221,69	0,00	0	0,00	0,00	0,00	8	0,02	62.221,69	0,00
12.000,00	23.999,99	31	0,06	605.063,25	0,01	0	0,00	0,00	0,00	31	0,06	605.063,25	0,01
24.000,00	35.999,99	1.115	2,33	36.344.811,66	0,68	54	3,60	10.551,72	2,52	1.115	2,33	36.334.259,94	0,68
36.000,00	47.999,99	3.050	6,38	129.542.233,58	2,44	106	7,06	20.321,21	4,86	3.050	6,38	129.521.912,37	2,44
48.000,00	59.999,99	4.269	8,92	231.527.585,61	4,36	138	9,19	24.046,84	5,75	4.269	8,92	231.503.538,77	4,36
60.000,00	71.999,99	4.814	10,06	317.930.843,18	5,99	150	9,99	31.888,56	7,63	4.814	10,06	317.898.954,62	5,99
72.000,00	83.999,99	5.012	10,48	391.163.449,45	7,37	185	12,33	45.072,82	10,78	5.012	10,48	391.118.376,63	7,37
84.000,00	95.999,99	4.841	10,12	435.458.644,22	8,20	155	10,33	37.934,65	9,07	4.841	10,12	435.420.709,57	8,20
96.000,00	107.999,99	4.727	9,88	481.099.819,37	9,06	139	9,26	36.496,50	8,73	4.727	9,88	481.063.322,87	9,06
108.000,00	119.999,99	3.952	8,26	450.385.502,91	8,48	110	7,33	31.595,91	7,56	3.952	8,26	450.353.907,00	8,48
120.000,00	131.999,99	3.313	6,93	417.182.514,07	7,86	95	6,33	28.164,02	6,74	3.313	6,93	417.154.350,05	7,86
132.000,00	143.999,99	2.610	5,46	359.296.432,28	6,77	97	6,46	29.334,21	7,02	2.610	5,46	359.267.098,07	6,77
144.000,00	155.999,99	2.083	4,35	312.002.357,64	5,88	66	4,40	23.929,06	5,72	2.083	4,35	311.978.428,58	5,88
156.000,00	167.999,99	1.625	3,40	263.029.887,46	4,95	54	3,60	20.395,77	4,88	1.625	3,40	263.009.491,69	4,95
168.000,00	179.999,99	1.299	2,72	225.541.458,74	4,25	39	2,60	15.571,64	3,72	1.299	2,72	225.525.887,10	4,25
180.000,00	191.999,99	946	1,98	175.754.255,49	3,31	28	1,87	10.724,73	2,57	946	1,98	175.743.530,76	3,31
192.000,00	203.999,99	810	1,69	159.982.521,09	3,01	29	1,93	13.021,39	3,11	810	1,69	159.969.499,70	3,01
204.000,00	215.999,99	612	1,28	128.356.529,24	2,42	13	0,87	5.824,68	1,39	612	1,28	128.350.704,56	2,42
216.000,00	227.999,99	490	1,02	108.821.521,77	2,05	6	0,40	3.248,69	0,78	490	1,02	108.818.273,08	2,05
228.000,00	239.999,99	386	0,81	90.276.992,46	1,70	7	0,47	4.534,41	1,08	386	0,81	90.272.458,05	1,70
240.000,00	251.999,99	340	0,71	83.461.497,55	1,57	9	0,60	8.932,48	2,14	340	0,71	83.452.565,07	1,57
252.000,00	263.999,99	232	0,48	59.823.562,08	1,13	5	0,33	2.467,16	0,59	232	0,48	59.821.094,92	1,13
264.000,00	275.999,99	191	0,40	51.531.465,56	0,97	3	0,20	1.081,02	0,26	191	0,40	51.530.384,54	0,97
276.000,00	287.999,99	162	0,34	45.698.681,89	0,86	0	0,00	0,00	0,00	162	0,34	45.698.681,89	0,86
288.000,00	299.999,99	160	0,33	46.946.939,43	0,88	3	0,20	1.593,57	0,38	160	0,33	46.945.345,86	0,88
300.000,00	311.999,99	116	0,24	35.436.276,10	0,67	1	0,07	406,32	0,10	116	0,24	35.435.869,78	0,67
312.000,00	323.999,99	96	0,20	30.502.070,85	0,57	2	0,13	1.158,80	0,28	96	0,20	30.500.912,05	0,57
324.000,00	335.999,99	76	0,16	25.087.204,12	0,47	2	0,13	2.643,22	0,63	76	0,16	25.084.560,90	0,47

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: 30/09/2024

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	64	0,13	21.876.112,36	0,41	0	0,00	0,00	0,00	64	0,13	21.876.112,36	0,41
348.000,00	359.999,99	44	0,09	15.564.721,37	0,29	0	0,00	0,00	0,00	44	0,09	15.564.721,37	0,29
360.000,00	371.999,99	56	0,12	20.510.132,35	0,39	0	0,00	0,00	0,00	56	0,12	20.510.132,35	0,39
372.000,00	383.999,99	32	0,07	12.092.784,76	0,23	2	0,13	1.502,08	0,36	32	0,07	12.091.282,68	0,23
384.000,00	395.999,99	30	0,06	11.704.023,73	0,22	0	0,00	0,00	0,00	30	0,06	11.704.023,73	0,22
396.000,00	407.999,99	31	0,06	12.471.553,18	0,23	0	0,00	0,00	0,00	31	0,06	12.471.553,18	0,23
408.000,00	419.999,99	26	0,05	10.801.312,73	0,20	3	0,20	5.651,53	1,35	26	0,05	10.795.661,20	0,20
420.000,00	431.999,99	21	0,04	8.937.350,11	0,17	0	0,00	0,00	0,00	21	0,04	8.937.350,11	0,17
432.000,00	443.999,99	13	0,03	5.679.543,70	0,11	0	0,00	0,00	0,00	13	0,03	5.679.543,70	0,11
444.000,00	455.999,99	12	0,03	5.397.885,19	0,10	0	0,00	0,00	0,00	12	0,03	5.397.885,19	0,10
456.000,00	467.999,99	10	0,02	4.603.600,93	0,09	0	0,00	0,00	0,00	10	0,02	4.603.600,93	0,09
468.000,00	479.999,99	13	0,03	6.178.392,03	0,12	0	0,00	0,00	0,00	13	0,03	6.178.392,03	0,12
480.000,00	491.999,99	15	0,03	7.281.779,73	0,14	0	0,00	0,00	0,00	15	0,03	7.281.779,73	0,14
492.000,00	503.999,99	5	0,01	2.487.101,55	0,05	0	0,00	0,00	0,00	5	0,01	2.487.101,55	0,05
504.000,00	515.999,99	5	0,01	2.538.118,80	0,05	0	0,00	0,00	0,00	5	0,01	2.538.118,80	0,05
516.000,00	527.999,99	6	0,01	3.127.093,50	0,06	0	0,00	0,00	0,00	6	0,01	3.127.093,50	0,06
528.000,00	539.999,99	10	0,02	5.344.631,46	0,10	0	0,00	0,00	0,00	10	0,02	5.344.631,46	0,10
540.000,00	551.999,99	4	0,01	2.187.641,27	0,04	0	0,00	0,00	0,00	4	0,01	2.187.641,27	0,04
552.000,00	563.999,99	8	0,02	4.456.539,30	0,08	0	0,00	0,00	0,00	8	0,02	4.456.539,30	0,08
564.000,00	575.999,99	3	0,01	1.708.886,30	0,03	0	0,00	0,00	0,00	3	0,01	1.708.886,30	0,03
576.000,00	587.999,99	4	0,01	2.328.905,82	0,04	0	0,00	0,00	0,00	4	0,01	2.328.905,82	0,04
588.000,00	599.999,99	1	0,00	599.606,81	0,01	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	599.606,81	0,01
600.000,00	611.999,99	4	0,01	2.432.395,42	0,05	0	0,00	0,00	0,00	4	0,01	2.432.395,42	0,05
612.000,00	623.999,99	2	0,00	1.237.531,90	0,02	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.237.531,90	0,02
636.000,00	647.999,99	5	0,01	3.206.668,34	0,06	0	0,00	0,00	0,00	5	0,01	3.206.668,34	0,06
648.000,00	659.999,99	3	0,01	1.966.641,38	0,04	0	0,00	0,00	0,00	3	0,01	1.966.641,38	0,04
660.000,00	671.999,99	2	0,00	1.322.088,01	0,02	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.322.088,01	0,02
672.000,00	683.999,99	2	0,00	1.353.405,82	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.353.405,82	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: 30/09/2024

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	%
684.000,00	695.999,99	2	0,00	1.375.733,51	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.375.733,51	0,03
696.000,00	707.999,99	1	0,00	700.938,41	0,01	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	700.938,41	0,01
708.000,00	719.999,99	2	0,00	1.421.115,42	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.421.115,42	0,03
720.000,00	731.999,99	1	0,00	726.768,56	0,01	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	726.768,56	0,01
732.000,00	743.999,99	1	0,00	735.105,92	0,01	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	735.105,92	0,01
744.000,00	755.999,99	3	0,01	2.245.578,80	0,04	0	0,00	0,00	0,00	3	0,01	2.245.578,80	0,04
756.000,00	767.999,99	5	0,01	3.795.988,17	0,07	0	0,00	0,00	0,00	5	0,01	3.795.988,17	0,07
768.000,00	779.999,99	1	0,00	770.156,89	0,01	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	770.156,89	0,01
792.000,00	803.999,99	2	0,00	1.596.816,11	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.596.816,11	0,03
804.000,00	815.999,99	2	0,00	1.614.861,08	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.614.861,08	0,03
828.000,00	839.999,99	1	0,00	829.442,78	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	829.442,78	0,02
840.000,00	851.999,99	1	0,00	849.860,24	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	849.860,24	0,02
888.000,00	899.999,99	1	0,00	891.337,33	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	891.337,33	0,02
912.000,00	923.999,99	2	0,00	1.838.963,99	0,03	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.838.963,99	0,03
924.000,00	935.999,99	1	0,00	927.054,91	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	927.054,91	0,02
972.000,00	983.999,99	2	0,00	1.952.985,12	0,04	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	1.952.985,12	0,04
996.000,00	1.007.999,99	1	0,00	1.005.932,06	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.005.932,06	0,02
1.044.000,00	1.055.999,99	1	0,00	1.046.618,20	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.046.618,20	0,02
1.056.000,00	1.067.999,99	1	0,00	1.063.052,30	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.063.052,30	0,02
1.068.000,00	1.079.999,99	1	0,00	1.075.873,69	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.075.873,69	0,02
1.092.000,00	1.103.999,99	1	0,00	1.099.484,03	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.099.484,03	0,02
1.140.000,00	1.151.999,99	2	0,00	2.285.771,26	0,04	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	2.285.771,26	0,04
1.260.000,00	1.271.999,99	1	0,00	1.271.990,48	0,02	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.271.990,48	0,02
1.608.000,00	1.619.999,99	2	0,00	3.222.147,98	0,06	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	3.222.147,98	0,06
1.860.000,00	1.871.999,99	1	0,00	1.868.253,88	0,04	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	1.868.253,88	0,04

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*: 30/09/2024
 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>	
Total :	47.836	100,00	5.308.460.621,71		1.501	100,00	418.092,99		47.836	100,00	5.308.042.528,72	
Media Ponderada / <i>Weighted Average</i> :												
Media Simple / <i>Average</i> :			110.972,08				278,54				110.963,34	
Mínimo / <i>Minimum</i> :			91,64				38,67				91,64	
Máximo / <i>Maximum</i> :			1.868.253,88				3.913,68				1.868.253,88	