

BBVA RMBS 23 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: 17/06/2024

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 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
2025	4	0,01	181.284,14	0,00	0	0,00	0,00	0,00	4	0,01	181.284,14	0,00	4,364%	16,043
2026	9	0,02	514.283,15	0,01	0	0,00	0,00	0,00	9	0,02	514.283,15	0,01	4,194%	26,761
2027	95	0,20	4.370.897,36	0,08	2	1,02	2.002,76	4,46	95	0,20	4.368.894,60	0,08	4,365%	38,783
2028	58	0,12	2.605.759,81	0,05	0	0,00	0,00	0,00	58	0,12	2.605.759,81	0,05	4,283%	49,449
2029	133	0,27	6.109.535,23	0,11	1	0,51	317,91	0,71	133	0,27	6.109.217,32	0,11	4,390%	61,745
2030	139	0,29	6.923.219,09	0,13	1	0,51	363,73	0,81	139	0,29	6.922.855,36	0,13	4,241%	73,453
2031	216	0,45	12.249.115,86	0,22	1	0,51	335,46	0,75	216	0,45	12.248.780,40	0,22	4,105%	85,326
2032	630	1,30	38.384.957,14	0,70	0	0,00	0,00	0,00	630	1,30	38.384.957,14	0,70	4,197%	97,816
2033	541	1,12	39.112.601,88	0,72	3	1,52	1.382,63	3,08	541	1,12	39.111.219,25	0,72	3,587%	109,683
2034	606	1,25	44.486.606,53	0,82	5	2,54	998,01	2,22	606	1,25	44.485.608,52	0,82	3,867%	120,922
2035	655	1,35	53.868.011,30	0,99	10	5,08	2.748,82	6,13	655	1,35	53.865.262,48	0,99	3,817%	133,748
2036	743	1,53	64.784.060,05	1,19	5	2,54	1.048,21	2,34	743	1,53	64.783.011,84	1,19	3,739%	145,298
2037	2.332	4,81	197.825.799,73	3,63	12	6,09	4.324,43	9,64	2.332	4,81	197.821.475,30	3,63	4,134%	157,502
2038	1.332	2,75	123.085.490,14	2,26	9	4,57	3.906,07	8,71	1.332	2,75	123.081.584,07	2,26	3,439%	169,863
2039	1.058	2,18	98.849.769,38	1,81	5	2,54	1.451,27	3,23	1.058	2,18	98.848.318,11	1,81	3,735%	180,608
2040	552	1,14	59.045.392,75	1,08	2	1,02	468,66	1,04	552	1,14	59.044.924,09	1,08	3,444%	193,306
2041	687	1,42	72.618.662,89	1,33	6	3,05	890,91	1,99	687	1,42	72.617.771,98	1,33	3,424%	205,503
2042	1.865	3,85	195.505.631,75	3,59	12	6,09	3.028,74	6,75	1.865	3,85	195.502.603,01	3,59	3,912%	217,340
2043	1.967	4,06	208.638.747,21	3,83	6	3,05	1.839,50	4,10	1.967	4,06	208.636.907,71	3,83	3,529%	229,993
2044	2.373	4,90	227.155.983,53	4,17	6	3,05	820,39	1,83	2.373	4,90	227.155.163,14	4,17	4,326%	241,061
2045	2.960	6,11	290.216.174,50	5,33	9	4,57	1.359,36	3,03	2.960	6,11	290.214.815,14	5,33	4,492%	253,877
2046	3.745	7,73	393.141.975,62	7,21	18	9,14	2.487,48	5,54	3.745	7,73	393.139.488,14	7,21	3,838%	265,039
2047	8.122	16,77	972.662.138,31	17,85	39	19,80	7.775,86	17,33	8.122	16,77	972.654.362,45	17,85	4,065%	277,312
2048	4.895	10,11	582.304.838,49	10,68	16	8,12	2.640,87	5,89	4.895	10,11	582.302.197,62	10,68	3,617%	288,767
2049	2.440	5,04	308.711.265,88	5,66	7	3,55	1.177,73	2,63	2.440	5,04	308.710.088,15	5,66	3,906%	300,137
2050	1.067	2,20	142.822.982,74	2,62	4	2,03	582,54	1,30	1.067	2,20	142.822.400,20	2,62	3,615%	313,416
2051	1.085	2,24	155.082.695,97	2,85	1	0,51	206,50	0,46	1.085	2,24	155.082.489,47	2,85	3,079%	324,297
2052	1.463	3,02	199.896.835,59	3,67	4	2,03	816,80	1,82	1.463	3,02	199.896.018,79	3,67	3,047%	338,753
2053	4.754	9,81	705.186.311,14	12,94	6	3,05	1.315,66	2,93	4.754	9,81	705.184.995,48	12,94	3,049%	350,313
2054	1.180	2,44	159.658.021,68	2,93	3	1,52	280,72	0,63	1.180	2,44	159.657.740,96	2,93	3,422%	356,722

BBVA RMBS 23 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*: 17/06/2024

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 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
2055	343	0,71	35.197.543,06	0,65	3	1,52	241,95	0,54	343	0,71	35.197.301,11	0,65	5,389%	373,863
2056	206	0,43	23.529.259,22	0,43	1	0,51	50,92	0,11	206	0,43	23.529.208,30	0,43	5,062%	383,746
2057	94	0,19	12.376.422,97	0,23	0	0,00	0,00	0,00	94	0,19	12.376.422,97	0,23	4,707%	397,789
2058	60	0,12	7.561.077,52	0,14	0	0,00	0,00	0,00	60	0,12	7.561.077,52	0,14	4,380%	407,860
2059	2	0,00	254.025,54	0,00	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	254.025,54	0,00	2,828%	421,576
2060	3	0,01	351.910,67	0,01	0	0,00	0,00	0,00	3	0,01	351.910,67	0,01	3,267%	431,733
2061	8	0,02	1.716.321,33	0,03	0	0,00	0,00	0,00	8	0,02	1.716.321,33	0,03	4,411%	445,442
2062	11	0,02	1.611.051,68	0,03	0	0,00	0,00	0,00	11	0,02	1.611.051,68	0,03	3,976%	457,720
2063	8	0,02	1.394.862,75	0,03	0	0,00	0,00	0,00	8	0,02	1.394.862,75	0,03	3,200%	470,863
Total :	48.441	100,00	5.449.991.523,58	100,00	197	100,00	44.863,89	100,00	48.441	100,00	5.449.946.659,69	100,00		
Media Ponderada / Weighted Average :														
Media Simple / Average :			112.507,82				227,74				112.506,90		3,744%	271,848
Mínimo / Minimum :			29.912,05				0,01				29.912,05		3,929%	259,875
Máximo / Maximum :			1.881.551,12				1.493,34				1.881.551,12		0,419%	31/03/2025
													8,975%	31/12/2063