

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: 30/09/2024

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
2024	1	0,00	673,73	0,00	0	0,00	0,00	0,00	1	0,00	673,73	0,00	4,480%	2,000
2025	4	0,01	158.672,73	0,00	0	0,00	0,00	0,00	4	0,01	158.672,73	0,00	3,994%	12,910
2026	15	0,03	557.559,93	0,01	0	0,00	0,00	0,00	15	0,03	557.559,93	0,01	3,767%	22,897
2027	99	0,21	4.076.430,58	0,08	6	0,40	4.046,72	0,97	99	0,21	4.072.383,86	0,08	4,274%	35,152
2028	64	0,13	2.554.534,69	0,05	1	0,07	768,61	0,18	64	0,13	2.553.766,08	0,05	4,109%	45,726
2029	133	0,28	5.689.696,90	0,11	4	0,27	3.636,96	0,87	133	0,28	5.686.059,94	0,11	4,175%	58,210
2030	153	0,32	7.438.717,34	0,14	5	0,33	1.898,47	0,45	153	0,32	7.436.818,87	0,14	3,984%	69,965
2031	232	0,48	12.398.488,66	0,23	8	0,53	7.476,68	1,79	232	0,48	12.391.011,98	0,23	3,867%	81,730
2032	627	1,31	36.781.354,27	0,69	17	1,13	9.891,68	2,37	627	1,31	36.771.462,59	0,69	4,027%	94,375
2033	533	1,11	36.919.696,49	0,70	15	1,00	8.509,59	2,04	533	1,11	36.911.186,90	0,70	3,474%	106,206
2034	600	1,25	42.962.607,78	0,81	26	1,73	9.973,32	2,39	600	1,25	42.952.634,46	0,81	3,743%	117,535
2035	657	1,37	52.708.004,55	0,99	29	1,93	13.910,35	3,33	657	1,37	52.694.094,20	0,99	3,692%	130,255
2036	746	1,56	63.267.185,59	1,19	28	1,87	8.811,36	2,11	746	1,56	63.258.374,23	1,19	3,573%	141,904
2037	2.302	4,81	190.677.909,96	3,59	95	6,33	40.926,53	9,79	2.302	4,81	190.636.983,43	3,59	3,976%	154,053
2038	1.310	2,74	119.638.476,27	2,25	44	2,93	16.192,30	3,87	1.310	2,74	119.622.283,97	2,25	3,303%	166,331
2039	1.062	2,22	96.599.328,34	1,82	25	1,67	8.234,04	1,97	1.062	2,22	96.591.094,30	1,82	3,618%	177,234
2040	568	1,19	59.663.438,23	1,12	17	1,13	5.350,67	1,28	568	1,19	59.658.087,56	1,12	3,405%	189,884
2041	683	1,43	70.994.105,24	1,34	18	1,20	5.563,63	1,33	683	1,43	70.988.541,61	1,34	3,307%	202,140
2042	1.838	3,84	190.230.338,98	3,58	74	4,93	20.703,42	4,95	1.838	3,84	190.209.635,56	3,58	3,768%	213,897
2043	1.941	4,06	202.969.230,63	3,82	37	2,47	12.073,28	2,89	1.941	4,06	202.957.157,35	3,82	3,398%	226,514
2044	2.341	4,89	222.621.300,94	4,19	73	4,86	14.570,83	3,49	2.341	4,89	222.606.730,11	4,19	4,197%	237,593
2045	2.899	6,06	279.896.770,90	5,27	90	6,00	22.379,54	5,35	2.899	6,06	279.874.391,36	5,27	4,332%	250,410
2046	3.688	7,71	382.766.741,54	7,21	100	6,66	22.487,26	5,38	3.688	7,71	382.744.254,28	7,21	3,666%	261,581
2047	7.999	16,72	948.470.047,68	17,87	378	25,18	93.033,80	22,25	7.999	16,72	948.377.013,88	17,87	3,847%	273,850
2048	4.804	10,04	564.863.534,29	10,64	162	10,79	37.714,68	9,02	4.804	10,04	564.825.819,61	10,64	3,392%	285,310
2049	2.400	5,02	300.384.929,52	5,66	74	4,93	16.246,49	3,89	2.400	5,02	300.368.683,03	5,66	3,778%	296,672
2050	1.052	2,20	138.992.571,38	2,62	31	2,07	6.730,60	1,61	1.052	2,20	138.985.840,78	2,62	3,421%	309,927
2051	1.070	2,24	151.707.072,96	2,86	24	1,60	4.551,30	1,09	1.070	2,24	151.702.521,66	2,86	2,905%	320,868
2052	1.451	3,03	196.597.856,13	3,70	20	1,33	4.974,87	1,19	1.451	3,03	196.592.881,26	3,70	2,915%	335,261
2053	4.684	9,79	688.915.666,33	12,98	52	3,46	10.813,16	2,59	4.684	9,79	688.904.853,17	12,98	2,821%	346,844

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: 30/09/2024

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
2054	1.166	2,44	156.447.108,18	2,95	30	2,00	4.255,27	1,02	1.166	2,44	156.442.852,91	2,95	3,379%	353,203
2055	333	0,70	33.859.859,72	0,64	8	0,53	828,77	0,20	333	0,70	33.859.030,95	0,64	5,255%	370,372
2056	202	0,42	22.775.634,95	0,43	6	0,40	981,17	0,23	202	0,42	22.774.653,78	0,43	4,948%	380,254
2057	91	0,19	11.523.951,45	0,22	3	0,20	341,82	0,08	91	0,19	11.523.609,63	0,22	4,574%	394,387
2058	57	0,12	7.212.704,19	0,14	1	0,07	215,82	0,05	57	0,12	7.212.488,37	0,14	4,453%	404,341
2059	2	0,00	252.504,46	0,00	0	0,00	0,00	0,00	2	0,00	252.504,46	0,00	2,833%	418,082
2060	3	0,01	350.317,61	0,01	0	0,00	0,00	0,00	3	0,01	350.317,61	0,01	3,686%	428,272
2061	8	0,02	1.710.452,96	0,03	0	0,00	0,00	0,00	8	0,02	1.710.452,96	0,03	4,806%	441,968
2062	10	0,02	1.436.494,18	0,03	0	0,00	0,00	0,00	10	0,02	1.436.494,18	0,03	4,238%	454,517
2063	8	0,02	1.388.651,45	0,03	0	0,00	0,00	0,00	8	0,02	1.388.651,45	0,03	3,034%	467,375
Total :	47.836	100,00	5.308.460.621,71	100,00	1.501	100,00	418.092,99	100,00	47.836	100,00	5.308.042.528,72	100,00		
Media Ponderada / Weighted Average :													3,569%	268,468
Media Simple / Average :			110.972,08				278,54				110.963,34		3,731%	255,984
Mínimo / Minimum :			91,64				38,67				91,64		0,000%	30/11/2024
Máximo / Maximum :			1.868.253,88				3.913,68				1.868.253,88		8,633%	31/12/2063