

# HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos

## Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

### Distribución por Intervalos de Relación Principal actual / Valor de Tasación (%CLTV) / Distribution by current Loan-to-Value Ratio (% CLTV) Intervals

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

Fecha / Date: 30/06/2024

Divisa / Currency : EUR

| Intervalos de %CLTV<br>%CLTV Intervals |        | Saldo Vivo de Principal<br>Outstanding Principal Balance |      |                  |      | Principal Vencido Impagado<br>Overdue Principal |       |                  |       | Principal Pendiente Vencimiento<br>Outstanding Principal |      |                  |      | %CLTV Media Ponderada<br>Weighted Average % CLTV |          |
|----------------------------------------|--------|----------------------------------------------------------|------|------------------|------|-------------------------------------------------|-------|------------------|-------|----------------------------------------------------------|------|------------------|------|--------------------------------------------------|----------|
|                                        |        | Num.                                                     | %    | Importe / Amount | %    | Num.                                            | %     | Importe / Amount | %     | Num.                                                     | %    | Importe / Amount | %    | SVP / OPB                                        | PPV / OP |
| 0,01                                   | 5,00   | 202                                                      | 8,61 | 2.532.928,89     | 1,73 | 25                                              | 10,96 | 1.544.004,53     | 90,00 | 190                                                      | 8,14 | 988.924,36       | 0,68 | 59,202                                           | 3,264    |
| 5,01                                   | 10,00  | 184                                                      | 7,85 | 3.103.907,01     | 2,12 | 8                                               | 3,51  | 1.934,07         | 0,11  | 184                                                      | 7,89 | 3.101.972,94     | 2,14 | 7,777                                            | 7,773    |
| 10,01                                  | 15,00  | 188                                                      | 8,02 | 5.012.796,63     | 3,42 | 12                                              | 5,26  | 3.177,71         | 0,19  | 188                                                      | 8,06 | 5.009.618,92     | 3,46 | 12,736                                           | 12,727   |
| 15,01                                  | 20,00  | 190                                                      | 8,10 | 6.033.081,78     | 4,12 | 18                                              | 7,89  | 8.484,79         | 0,49  | 190                                                      | 8,14 | 6.024.596,99     | 4,16 | 17,741                                           | 17,715   |
| 20,01                                  | 25,00  | 179                                                      | 7,63 | 7.502.087,71     | 5,12 | 19                                              | 8,33  | 8.155,03         | 0,48  | 179                                                      | 7,67 | 7.493.932,68     | 5,18 | 22,448                                           | 22,423   |
| 25,01                                  | 30,00  | 145                                                      | 6,18 | 7.073.014,82     | 4,83 | 11                                              | 4,82  | 6.183,19         | 0,36  | 145                                                      | 6,22 | 7.066.831,63     | 4,88 | 27,552                                           | 27,529   |
| 30,01                                  | 35,00  | 135                                                      | 5,76 | 7.916.576,12     | 5,41 | 15                                              | 6,58  | 6.251,08         | 0,36  | 135                                                      | 5,79 | 7.910.325,04     | 5,47 | 32,702                                           | 32,676   |
| 35,01                                  | 40,00  | 122                                                      | 5,20 | 8.345.536,55     | 5,70 | 8                                               | 3,51  | 4.402,32         | 0,26  | 122                                                      | 5,23 | 8.341.134,23     | 5,76 | 37,635                                           | 37,615   |
| 40,01                                  | 45,00  | 118                                                      | 5,03 | 9.221.649,48     | 6,30 | 8                                               | 3,51  | 5.872,85         | 0,34  | 118                                                      | 5,06 | 9.215.776,63     | 6,37 | 42,462                                           | 42,436   |
| 45,01                                  | 50,00  | 135                                                      | 5,76 | 11.375.172,72    | 7,77 | 18                                              | 7,89  | 11.614,84        | 0,68  | 135                                                      | 5,79 | 11.363.557,88    | 7,85 | 47,655                                           | 47,607   |
| 50,01                                  | 55,00  | 126                                                      | 5,37 | 11.723.550,05    | 8,01 | 13                                              | 5,70  | 28.995,24        | 1,69  | 126                                                      | 5,40 | 11.694.554,81    | 8,08 | 52,525                                           | 52,349   |
| 55,01                                  | 60,00  | 103                                                      | 4,39 | 10.455.079,41    | 7,14 | 18                                              | 7,89  | 15.131,65        | 0,88  | 103                                                      | 4,41 | 10.439.947,76    | 7,21 | 57,455                                           | 57,370   |
| 60,01                                  | 65,00  | 125                                                      | 5,33 | 12.763.764,28    | 8,72 | 10                                              | 4,39  | 6.621,22         | 0,39  | 125                                                      | 5,36 | 12.757.143,06    | 8,81 | 62,355                                           | 62,322   |
| 65,01                                  | 70,00  | 94                                                       | 4,01 | 10.531.673,19    | 7,19 | 11                                              | 4,82  | 9.163,93         | 0,53  | 94                                                       | 4,03 | 10.522.509,26    | 7,27 | 67,650                                           | 67,591   |
| 70,01                                  | 75,00  | 64                                                       | 2,73 | 6.447.216,45     | 4,40 | 6                                               | 2,63  | 27.306,55        | 1,59  | 64                                                       | 2,74 | 6.419.909,90     | 4,44 | 72,835                                           | 72,406   |
| 75,01                                  | 80,00  | 49                                                       | 2,09 | 5.268.265,77     | 3,60 | 4                                               | 1,75  | 2.055,67         | 0,12  | 49                                                       | 2,10 | 5.266.210,10     | 3,64 | 77,226                                           | 77,196   |
| 80,01                                  | 85,00  | 42                                                       | 1,79 | 4.456.583,31     | 3,04 | 7                                               | 3,07  | 3.995,05         | 0,23  | 42                                                       | 1,80 | 4.452.588,26     | 3,08 | 82,739                                           | 82,667   |
| 85,01                                  | 90,00  | 29                                                       | 1,24 | 3.471.506,68     | 2,37 | 5                                               | 2,19  | 6.462,17         | 0,38  | 29                                                       | 1,24 | 3.465.044,51     | 2,39 | 87,125                                           | 86,964   |
| 90,01                                  | 95,00  | 19                                                       | 0,81 | 1.776.427,53     | 1,21 | 2                                               | 0,88  | 903,10           | 0,05  | 19                                                       | 0,81 | 1.775.524,43     | 1,23 | 93,175                                           | 93,126   |
| 95,01                                  | 100,00 | 25                                                       | 1,07 | 2.878.572,57     | 1,97 | 2                                               | 0,88  | 580,52           | 0,03  | 25                                                       | 1,07 | 2.877.992,05     | 1,99 | 97,101                                           | 97,082   |
| 100,01                                 | 105,00 | 16                                                       | 0,68 | 2.077.621,66     | 1,42 | 3                                               | 1,32  | 10.977,86        | 0,64  | 16                                                       | 0,69 | 2.066.643,80     | 1,43 | 103,274                                          | 102,692  |
| 105,01                                 | 110,00 | 15                                                       | 0,64 | 1.872.034,61     | 1,28 | 2                                               | 0,88  | 1.191,48         | 0,07  | 15                                                       | 0,64 | 1.870.843,13     | 1,29 | 107,090                                          | 107,022  |
| 110,01                                 | 115,00 | 5                                                        | 0,21 | 566.924,22       | 0,39 | 1                                               | 0,44  | 585,49           | 0,03  | 5                                                        | 0,21 | 566.338,73       | 0,39 | 112,097                                          | 111,980  |
| 115,01                                 | 120,00 | 10                                                       | 0,43 | 1.383.373,20     | 0,94 | 0                                               | 0,00  | 0,00             | 0,00  | 10                                                       | 0,43 | 1.383.373,20     | 0,96 | 117,816                                          | 117,816  |
| 120,01                                 | 125,00 | 2                                                        | 0,09 | 208.082,57       | 0,14 | 0                                               | 0,00  | 0,00             | 0,00  | 2                                                        | 0,09 | 208.082,57       | 0,14 | 120,578                                          | 120,578  |
| 125,01                                 | 130,00 | 5                                                        | 0,21 | 450.096,79       | 0,31 | 0                                               | 0,00  | 0,00             | 0,00  | 5                                                        | 0,21 | 450.096,79       | 0,31 | 126,992                                          | 126,992  |
| 130,01                                 | 135,00 | 4                                                        | 0,17 | 581.825,88       | 0,40 | 1                                               | 0,44  | 780,92           | 0,05  | 4                                                        | 0,17 | 581.044,96       | 0,40 | 131,799                                          | 131,623  |
| 135,01                                 | 140,00 | 2                                                        | 0,09 | 172.897,87       | 0,12 | 0                                               | 0,00  | 0,00             | 0,00  | 2                                                        | 0,09 | 172.897,87       | 0,12 | 138,894                                          | 138,894  |
| 140,01                                 | 145,00 | 4                                                        | 0,17 | 512.979,28       | 0,35 | 0                                               | 0,00  | 0,00             | 0,00  | 4                                                        | 0,17 | 512.979,28       | 0,35 | 142,454                                          | 142,454  |
| 150,01                                 | 155,00 | 2                                                        | 0,09 | 183.556,57       | 0,13 | 0                                               | 0,00  | 0,00             | 0,00  | 2                                                        | 0,09 | 183.556,57       | 0,13 | 152,464                                          | 152,464  |

HIPOCAT 11 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Intervalos de Relación Principal actual / Valor de Tasación (%CLTV) / Distribution by current Loan-to-Value Ratio (% CLTV) Intervals

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

Fecha / Date: 30/06/2024

Divisa / Currency : EUR

| Intervalos de %CLTV<br>%CLTV Intervals |        | Saldo Vivo de Principal<br>Outstanding Principal Balance |        |                  |        | Principal Vencido Impagado<br>Overdue Principal |        |                  |        | Principal Pendiente Vencimiento<br>Outstanding Principal |        |                  |        | %CLTV Media Ponderada<br>Weighted Average % CLTV |          |
|----------------------------------------|--------|----------------------------------------------------------|--------|------------------|--------|-------------------------------------------------|--------|------------------|--------|----------------------------------------------------------|--------|------------------|--------|--------------------------------------------------|----------|
|                                        |        | Num.                                                     | %      | Importe / Amount | %      | Num.                                            | %      | Importe / Amount | %      | Num.                                                     | %      | Importe / Amount | %      | SVP / OPB                                        | PPV / OP |
| 155,01                                 | 160,00 | 1                                                        | 0,04   | 86.200,17        | 0,06   | 0                                               | 0,00   | 0,00             | 0,00   | 1                                                        | 0,04   | 86.200,17        | 0,06   | 155,798                                          | 155,798  |
| 160,01                                 | 165,00 | 2                                                        | 0,09   | 218.851,00       | 0,15   | 0                                               | 0,00   | 0,00             | 0,00   | 2                                                        | 0,09   | 218.851,00       | 0,15   | 164,595                                          | 164,595  |
| 165,01                                 | 170,00 | 1                                                        | 0,04   | 54.728,97        | 0,04   | 0                                               | 0,00   | 0,00             | 0,00   | 1                                                        | 0,04   | 54.728,97        | 0,04   | 166,511                                          | 166,511  |
| 175,01                                 | 180,00 | 1                                                        | 0,04   | 70.655,08        | 0,05   | 0                                               | 0,00   | 0,00             | 0,00   | 1                                                        | 0,04   | 70.655,08        | 0,05   | 175,785                                          | 175,785  |
| 215,01                                 | 220,00 | 1                                                        | 0,04   | 111.385,74       | 0,08   | 1                                               | 0,44   | 679,17           | 0,04   | 1                                                        | 0,04   | 110.706,57       | 0,08   | 217,444                                          | 216,118  |
| Total :                                |        | 2.345                                                    | 100,00 | 146.440.604,56   | 100,00 | 228                                             | 100,00 | 1.715.510,43     | 100,00 | 2.333                                                    | 100,00 | 144.725.094,13   | 100,00 |                                                  |          |
| Media Ponderada / Weighted Average :   |        |                                                          |        |                  |        |                                                 |        |                  |        |                                                          |        |                  |        | 54,310                                           | 53,793   |
| Media Simple / Average :               |        |                                                          |        | 62.448,02        |        |                                                 |        | 7.524,17         |        |                                                          |        | 62.033,90        |        | 38,724                                           | 38,290   |
| Mínimo / Minimum :                     |        |                                                          |        | 100,71           |        |                                                 |        | 16,14            |        |                                                          |        | 100,71           |        | 0,031                                            | 0,031    |
| Máximo / Maximum :                     |        |                                                          |        | 525.998,25       |        |                                                 |        | 345.617,39       |        |                                                          |        | 522.894,70       |        | 217,444                                          | 216,118  |