

RURAL HIPOTECARIO XI Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Distribución por Índices de Referencia / Distribution by Reference Indexes

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

Fecha / Date: 31/10/2020

Divisa / Currency: EUR

Índices de Referencia Reference Indexes	Saldo Vivo de Principal Outstanding Principal Balance				Principal Vencido Impagado Overdue Principal				Principal Pendiente Vencimiento Outstanding Principal				Tipo Int. Int. Rate	Margen s/Índice Margin o/Index		
	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Num.	%	Importe / Amount	%	Med.Pond. W. Avg.	M.Pond. W. Avg.	Min.	Max.
Interés Variable Floating Interest	10.171	99,99	625.204.009,75	100,00	805	100,00	958.619,80	100,00	10.165	99,99	624.245.389,95	100,00	0,807%			
EURIBOR/MIBOR a 1 año 1-year EURIBOR/MIBOR	144	1,42	6.174.890,70	0,99	4	0,50	3.211,09	0,33	144	1,42	6.171.679,61	0,99	0,917%	0,920	0,400	2,000
EURIBOR/MIBOR a 1 año (M. Hipotecario) 1-year EURIBOR/MIBOR (Mortgage Market)	9.449	92,89	587.217.102,04	93,92	746	92,67	900.720,25	93,96	9.443	92,89	586.316.381,79	93,92	0,749%	0,845	-0,200	4,000
M. Hipotecario Conjunto de Entidades Mortgage Market: All Institutions	362	3,56	20.722.495,32	3,31	27	3,35	33.783,42	3,52	362	3,56	20.688.711,90	3,31	2,052%	0,248	0,000	2,250
M. Secundario Deuda Pública 2-6 años Secondary Market Public Debt 2-6 years	216	2,12	11.089.521,69	1,77	28	3,48	20.905,04	2,18	216	2,12	11.068.616,65	1,77	1,490%	1,626	0,000	2,331
No Definido	1	0,01	17.553,82	0,00	0	0,00	0,00	0,00	1	0,01	17.553,82	0,00	0,310%			
Bonos No translated	1	0,01	17.553,82	0,00	0	0,00	0,00	0,00	1	0,01	17.553,82	0,00	0,310%	0,750	0,750	0,750
Total :	10.172	100,00	625.221.563,57	100,00	805	100,00	958.619,80	100,00	10.166	100,00	624.262.943,77	100,00				
Media Ponderada / Weighted Average :													0,807%			
Media Simple / Average :			61.464,96				1.190,83				61.406,94		0,835%			
Mínimo / Minimum :			0,83				0,02				0,83		0,000%			
Máximo / Maximum :			353.143,21				228.457,78				353.143,21		5,250%			