

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: 30/09/2023

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	8.046	100,00	417.496.203,30	100,00	610	100,00	393.928,16	100,00	8.039	100,00	417.102.275,14	100,00	4,309%			
EURIBOR/MIBOR a 3 meses 3-month EURIBOR/MIBOR	1	0,01	6.032,16	0,00	0	0,00	0,00	0,00	1	0,01	6.032,16	0,00	4,576%	0,750	0,750	0,750
EURIBOR/MIBOR a 1 año 1-year EURIBOR/MIBOR	97	1,21	3.429.346,30	0,82	4	0,66	13.417,27	3,41	97	1,21	3.415.929,03	0,82	4,052%	0,956	0,400	2,000
EURIBOR/MIBOR a 1 año (M. Hipotecario) 1-year EURIBOR/MIBOR (Mortgage Market)	7.475	92,90	392.324.407,89	93,97	560	91,80	365.329,26	92,74	7.468	92,90	391.959.078,63	93,97	4,338%	0,856	-0,200	8,000
M. Hipotecario Conjunto de Entidades Mortgage Market: All Institutions	292	3,63	14.258.346,73	3,42	22	3,61	9.421,84	2,39	292	3,63	14.248.924,89	3,42	3,590%	0,230	0,000	2,000
M. Secundario Deuda Pública 2-6 años Secondary Market Public Debt 2-6 years	181	2,25	7.478.070,22	1,79	24	3,93	5.759,79	1,46	181	2,25	7.472.310,43	1,79	4,281%	1,637	0,000	2,331
Total :	8.046	100,00	417.496.203,30	100,00	610	100,00	393.928,16	100,00	8.039	100,00	417.102.275,14	100,00				
Media Ponderada / Weighted Average :													4,309%			
Media Simple / Average :			51.888,67				645,78				51.884,85		4,317%			
Mínimo / Minimum :			1,76				0,05				1,76		0,000%			
Máximo / Maximum :			310.782,55				36.430,97				310.782,55		7,362%			

Medias ponderadas por el principal pendiente de vencimiento / Averages weighted by the outstanding principal.

Tipo Interés: Tipo de interés nominal anual / Interest Rate: Annual nominal interest rate.