

BBVA RMBS 3 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Análisis de morosidad: Tasa de entrada acumulada en mora +3 meses (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos

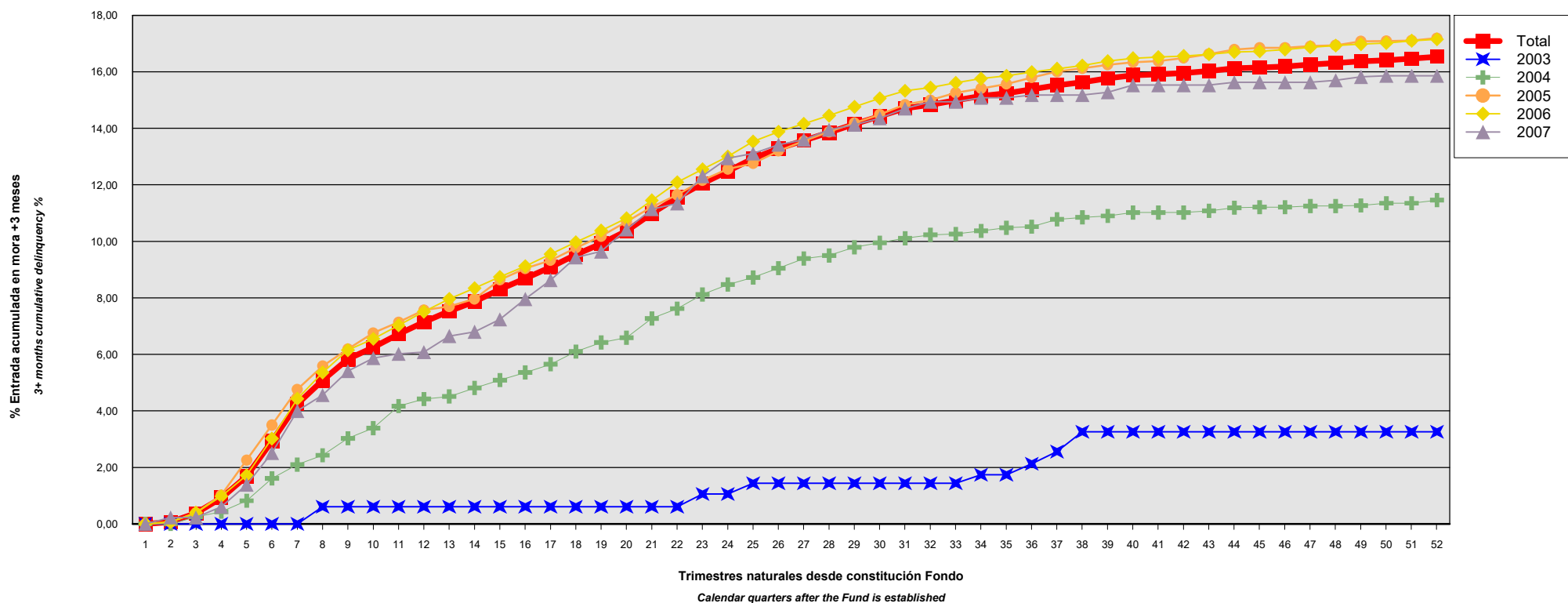
Delinquency analysis: 3+ months cumulative delinquency rate (calendar quarters after the Fund is established) - Detailed by asset origination years

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

Fecha / Date: 31/05/2020

Divisa / Currency: EUR

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros o actualización de información de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad / This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections or information update of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates



BBVA RMBS 3 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Análisis de morosidad: Tasa de entrada acumulada en mora +3 meses (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos

Delinquency analysis: 3+ months cumulative delinquency rate (calendar quarters after the Fund is established) - Detailed by asset origination years

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

Fecha / Date: 31/05/2020

Divisa / Currency: EUR

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros o actualización de información de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad / This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections or information update of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates

Originación activo Asset origination	Total	2003	2004	2005	2006	2007
Principal titulizado (mill. €) Principal securitised (€ million)	3.000,000	28,460	225,848	399,435	2.190,462	155,795
Nº activos / N°. of assets	16.933	230	1.581	2.424	11.835	863
1	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0	0,00% 0
2	0,07% 13	0,00% 0	0,00% 0	0,07% 2	0,07% 9	0,23% 2
3	0,38% 62	0,00% 0	0,25% 4	0,39% 9	0,40% 47	0,23% 2
4	0,92% 151	0,00% 0	0,43% 7	1,02% 24	0,98% 115	0,61% 5
5	1,69% 278	0,00% 0	0,82% 13	2,26% 49	1,72% 204	1,39% 12
6	2,92% 479	0,00% 0	1,61% 24	3,50% 79	3,02% 355	2,51% 21
7	4,24% 695	0,00% 0	2,10% 33	4,76% 108	4,43% 520	4,00% 34
8	5,08% 834	0,61% 1	2,43% 38	5,59% 128	5,36% 628	4,56% 39
9	5,83% 961	0,61% 1	3,03% 48	6,19% 144	6,15% 722	5,41% 46
10	6,25% 1.035	0,61% 1	3,39% 54	6,76% 159	6,55% 770	5,87% 51
11	6,72% 1.116	0,61% 1	4,17% 66	7,14% 168	7,03% 828	6,02% 53
12	7,14% 1.187	0,61% 1	4,42% 70	7,57% 178	7,51% 884	6,08% 54
13	7,53% 1.253	0,61% 1	4,51% 71	7,70% 182	7,96% 940	6,65% 59
14	7,87% 1.304	0,61% 1	4,81% 73	7,96% 188	8,34% 982	6,80% 60
15	8,30% 1.380	0,61% 1	5,09% 77	8,64% 208	8,74% 1.029	7,24% 65
16	8,69% 1.445	0,61% 1	5,36% 81	9,04% 218	9,12% 1.078	7,96% 71
17	9,09% 1.521	0,61% 1	5,65% 88	9,33% 226	9,55% 1.130	8,63% 76
18	9,53% 1.596	0,61% 1	6,10% 95	9,77% 237	9,97% 1.183	9,43% 82

BBVA RMBS 3 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Análisis de morosidad: Tasa de entrada acumulada en mora +3 meses (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos

Delinquency analysis: 3+ months cumulative delinquency rate (calendar quarters after the Fund is established) - Detailed by asset origination years

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

Fecha / Date: 31/05/2020

Divisa / Currency: EUR

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros o actualización de información de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad / This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections or information update of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates

	Total	2003	2004	2005	2006	2007
19	9,92%1.665	0,61% 1	6,42% 101	10,18% 246	10,38%1.233	9,64% 84
20	10,37%1.743	0,61% 1	6,59% 104	10,70% 260	10,82%1.288	10,42% 90
21	10,99%1.854	0,61% 1	7,27% 114	11,22% 273	11,45%1.369	11,14% 97
22	11,55%1.948	0,61% 1	7,62% 119	11,65% 284	12,09%1.445	11,34% 99
23	12,05%2.035	1,06% 2	8,12% 129	12,16% 296	12,55%1.500	12,31% 108
24	12,48%2.115	1,06% 2	8,47% 135	12,56% 306	13,00%1.557	12,94% 115
25	12,93%2.191	1,44% 3	8,72% 139	12,76% 312	13,53%1.621	13,11% 116
26	13,29%2.258	1,44% 3	9,05% 145	13,20% 325	13,88%1.666	13,42% 120
27	13,57%2.313	1,44% 3	9,39% 152	13,55% 334	14,16%1.702	13,60% 122
28	13,85%2.363	1,44% 3	9,50% 155	13,88% 342	14,45%1.737	13,95% 126
29	14,15%2.417	1,44% 3	9,79% 160	14,19% 349	14,76%1.777	14,13% 128
30	14,43%2.470	1,44% 3	9,95% 163	14,49% 358	15,06%1.816	14,36% 130
31	14,71%2.525	1,44% 3	10,11% 167	14,84% 368	15,33%1.853	14,70% 134
32	14,83%2.548	1,44% 3	10,23% 169	15,00% 373	15,44%1.867	14,94% 136
33	14,99%2.581	1,44% 3	10,26% 170	15,26% 382	15,61%1.890	14,94% 136
34	15,14%2.607	1,74% 4	10,37% 172	15,41% 386	15,76%1.908	15,08% 137
35	15,24%2.630	1,74% 4	10,48% 174	15,57% 392	15,86%1.923	15,08% 137
36	15,38%2.658	2,13% 5	10,52% 175	15,80% 400	15,99%1.941	15,18% 138
37	15,52%2.687	2,56% 6	10,78% 180	16,01% 406	16,11%1.957	15,18% 138
38	15,63%2.708	3,26% 7	10,85% 182	16,12% 410	16,22%1.971	15,18% 138
39	15,77%2.733	3,26% 7	10,90% 183	16,25% 414	16,38%1.990	15,28% 139
40	15,88%2.758	3,26% 7	11,02% 186	16,34% 417	16,48%2.007	15,53% 141
41	15,91%2.765	3,26% 7	11,02% 186	16,38% 418	16,52%2.013	15,53% 141
42	15,96%2.773	3,26% 7	11,02% 186	16,49% 421	16,56%2.018	15,53% 141

BBVA RMBS 3 Fondo de Titulización de Activos

Cartera de Activos Titulizados / Portfolio of Securitised Assets

Análisis de morosidad: Tasa de entrada acumulada en mora +3 meses (trimestres naturales desde constitución Fondo) - Detalle por años originación activos

Delinquency analysis: 3+ months cumulative delinquency rate (calendar quarters after the Fund is established) - Detailed by asset origination years

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

Fecha / Date: 31/05/2020

Divisa / Currency: EUR

Esta serie histórica calculada a esta fecha puede diferir de las series históricas calculadas con anterioridad a consecuencia de cobros o actualización de información de los activos titulizados comunicados o modificados por el Administrador correspondiente con posterioridad a sus fechas de efectividad / This historical series calculated as at today's date may differ from previously calculated historical series following collections or information update of the securitised assets communicated or modified by the relevant Servicer after their effective dates

	Total	2003	2004	2005	2006	2007
43	16,03% 2.792	3,26% 7	11,08% 188	16,63% 426	16,62% 2.030	15,53% 141
44	16,12% 2.813	3,26% 7	11,19% 190	16,79% 431	16,70% 2.043	15,63% 142
45	16,15% 2.821	3,26% 7	11,21% 191	16,85% 432	16,73% 2.049	15,63% 142
46	16,19% 2.830	3,26% 7	11,21% 191	16,85% 432	16,79% 2.058	15,63% 142
47	16,26% 2.845	3,26% 7	11,25% 192	16,91% 434	16,87% 2.070	15,63% 142
48	16,31% 2.856	3,26% 7	11,25% 192	16,94% 435	16,93% 2.079	15,70% 143
49	16,37% 2.872	3,26% 7	11,27% 193	17,08% 440	16,98% 2.088	15,82% 144
50	16,41% 2.882	3,26% 7	11,35% 195	17,09% 441	17,02% 2.094	15,86% 145
51	16,47% 2.895	3,26% 7	11,35% 195	17,11% 442	17,10% 2.106	15,86% 145
52	16,53% 2.908	3,26% 7	11,46% 197	17,19% 445	17,15% 2.114	15,86% 145