

CAIXABANK PYMES 11, F.T.

INFORMACIÓN MENSUAL A 30/06/2020 / MONTHLY INFORMATION AS OF 30/06/2020

| | | | |
|--|-----------------------------------|-------------------------------------|-------------------------|
| Fecha Constitución | 26/11/2019 | Fecha Desembolso | 29/11/2019 |
| Sociedad Gestora | CAIXABANK TITULIZACION, SGFT, SAU | Directores y Aseguradores | CAIXABANK, S.A. |
| Originadores y Administradores | CAIXABANK, S.A. | Agente de Pagos | CAIXABANK, S.A. |
| Cta. Tesorería Tipo Garantizado | CAIXABANK, S.A. | Mercado Negociación | AIAF MERCADO RENTA FIJA |
| Préstamo Sub. Gastos Constitución | CAIXABANK, S.A. | Registro Contable de Valores | IBERCLEAR |
| Préstamo Sub. Fondo Reserva | CAIXABANK, S.A. | Auditores | PWC |

**1/ BONOS DE TITULIZACIÓN (ESTRUCTURA PREFERENTE/SUBORDINADA) /
SECURITISATION BONDS (SENIOR/SUBORDINATED STRUCTURE)**

| Serie Código ISIN Prelación | Fecha Emisión | Nominal Circulación (Unitario/Total) | | Intereses | Tipo interés Bruto Actual Unitario | Amortización | | Calificación Actual | |
|------------------------------------|------------------|---|--|--|--|------------------------------|-----------------------|---------------------|--------------|
| | | Actual | Inicial | | | Final | Próxima Frecuencia | MOODY'S | DBRS |
| "A" ES0305460000 Preferente | 29/11/2019 | 89.451,32 21.315 Bonos 1.906.654.885,80 | 100.000,00 21.315 Bonos 2.131.500.000,00 | Variable Interes Fijo Trimestral | 0,7500 % 169,58 ⁽³⁾ | 01/10/2048 (2) Trimestral | 22/07/2020 | Aa2(sf) | AA (low)(sf) |
| "B" ES0305460018 Subordinada | 29/11/2019 | 100.000,00 3.185 Bonos 318.500.000,00 | 100.000,00 3.185 Bonos 318.500.000,00 | Variable Interes Fijo Trimestral | 0,8000 % 202,22 ⁽³⁾ | 01/10/2048 (2) Trimestral | 22/07/2020 | Caa1(sf) | B(sf) |
| Totales | | 2.225.154.885,80 | 2.450.000.000,00 | | | | | | |

**VIDA MEDIA RESIDUAL EN AÑOS Y AMORTIZACIÓN FINAL ESTIMADAS SEGÚN TASAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA /
RESIDUAL AVERAGE LIFE IN YEARS AND MATURITY ACCORDING TO CONSTANT PREPAYMENT RATES (CPR) (4)**

| | | TASA AMORTIZACIÓN ANTICIPADA | | | | | | | |
|----------------------|---|------------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| % mensual constante | | 0.00 | 0.63 | 0.75 | 1.00 | 1.25 | 1.50 | 1.75 | 2.00 |
| % anual equivalente | | 0.00 | 7.35 | 8.64 | 11.36 | 14.01 | 16.59 | 19.09 | 21.53 |
| BONOS SERIE A | ISIN:ES0305460000 | | | | | | | | |
| | Sin ejercicio amortización opcional | | | | | | | | |
| | Vida media | 3.23 | 2.11 | 2.01 | 1.83 | 1.69 | 1.57 | 1.47 | 1.38 |
| | Amortización Final | 22/10/2030 | 22/04/2025 | 22/10/2024 | 22/04/2024 | 22/01/2024 | 23/10/2023 | 24/07/2023 | 24/04/2023 |
| | Con ejercicio amortización opcional (1) | | | | | | | | |
| | Vida media | 3.23 | 2.11 | 2.01 | 1.83 | 1.69 | 1.57 | 1.47 | 1.38 |
| | Amortización Final | 22/10/2030 | 22/04/2025 | 22/10/2024 | 22/04/2024 | 22/01/2024 | 23/10/2023 | 24/07/2023 | 24/04/2023 |
| BONOS SERIE B | ISIN:ES0305460018 | | | | | | | | |
| | Sin ejercicio amortización opcional | | | | | | | | |
| | Vida media | 28.92 | 8.12 | 7.10 | 5.84 | 5.33 | 4.82 | 4.57 | 4.06 |
| | Amortización Final | 22/10/2048 | 24/04/2028 | 22/04/2027 | 22/01/2026 | 22/07/2025 | 22/01/2025 | 22/10/2024 | 22/04/2024 |
| | Con ejercicio amortización opcional (1) | | | | | | | | |
| | Vida media | 13.70 | 5.58 | 5.33 | 4.82 | 4.31 | 4.06 | 3.81 | 3.55 |
| | Amortización Final | 24/10/2033 | 22/10/2025 | 22/07/2025 | 22/01/2025 | 22/07/2024 | 22/04/2024 | 22/01/2024 | 23/10/2023 |

(1) Amortización a opción de la Sociedad Gestora cuando el importe del Principal pendiente de amortizar de los Activos Cedidos sea inferior al 10% del inicial y todas las obligaciones de pago derivadas de los Bonos puedan ser atendidas y canceladas en su totalidad.

(2) Fecha teórica de liquidación del Fondo de Titulización.

(3) Interés Bruto Unitario a pagar en el próximo cupón.

(4) Otros datos utilizados: Tasa Morosidad - 0,9107%, Tasa Recuperación Morosidad - 33,5958%, Tasa Fallidos - 0,0504% y Tasa Recuperación Fallidos - 0,4106%.

2/ ACTIVO AGRUPADO: PRÉSTAMOS / POOL: LOANS

| Préstamos | | | |
|-----------------------|------------|------------------|--------------------|
| | | Actual | Fecha Constitución |
| Principal Nominal | Número | 33.030 | 35.236 |
| | Importe | 2.064.815.029,31 | 2.449.553.598,14 |
| Principal Vivo | Número | 33.068 | 35.236 |
| | Importe | 2.067.609.385,81 | 2.450.000.000,00 |
| Interés | Media Pond | 1,97 % | 1,97 % |
| | Mínimo | 0,00 % | 0,00 % |
| | Máximo | 15,00 % | 15,00 % |
| Vida Residual (meses) | Media Pond | 79,045 | 80,418 |
| | Mínima | 0,000 | 1,051 |
| | Máxima | 339,288 | 346,290 |

| CNAE | | |
|--|---------|---------------|
| | Actual | Valor Inicial |
| 10-Industria de la alimentación. | 4,44 % | 4,40 % |
| 11-Fabricación de bebidas. | 3,03 % | 2,94 % |
| 12-Industria del tabaco. | 2,56 % | 2,43 % |
| 14-Confección de prendas de vestir. | 2,13 % | 2,14 % |
| 16-Industria de la madera y del corcho, | 1,54 % | 1,51 % |
| 41-Construcción de edificios. | 4,15 % | 4,14 % |
| 43-Actividades de construcción especiali | 1,98 % | 2,10 % |
| 45-Venta y reparaciónde vehículos de mot | 1,80 % | 1,79 % |
| 46-Comercio al por mayor e intermediario | 8,30 % | 8,93 % |
| 47-Comercio al por menor, excepto de veh | 6,14 % | 6,06 % |
| 49-Transporte terrestre y por tubería. | 4,13 % | 3,96 % |
| 56-Servicios de comidas y bebidas. | 4,76 % | 4,68 % |
| 68-Actividades inmobiliarias. | 10,72 % | 11,02 % |
| 69-Actividades jurídicas y de contabilid | 0,95 % | 0,96 % |
| 74-Otras actividades profesionales, cien | 1,63 % | 1,52 % |
| 85-Educación. | 1,08 % | 1,12 % |
| 86-Actividades sanitarias. | 1,98 % | 1,89 % |
| 96-Otros servicios personales. | 1,42 % | 1,34 % |
| Otros | 37,26 % | 37,07 % |

| Amortización Anticipada | | | | |
|-------------------------|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | Último mes | Últimos tres meses | Últimos seis meses | Últimos doce meses |
| Tasa Mensual Constante | 0,7239 % | 0,5974 % | 0,6344 % | 0,0000 % |
| Tasa Anual Equivalente | 8,3492 % | 6,9384 % | 7,3532 % | 0,0000 % |

| Distribución Geográfica | | |
|-------------------------|---------|--------------------|
| | Actual | Fecha Constitución |
| Cataluña | 27,15 % | 26,92 % |
| Madrid | 11,61 % | 11,99 % |
| Andalucía | 12,12 % | 11,88 % |
| Comunidad Valenciana | 11,69 % | 11,55 % |
| Aragón | 2,30 % | 2,27 % |
| Baleares | 7,10 % | 7,05 % |
| Otras Comunidades | 28,03 % | 28,34 % |

| Indice Referencia (Distribución en % sobre el número de préstamos) | | |
|--|---------|---------------|
| | Actual | Valor Inicial |
| TIPO FIJO | 69,81 % | 69,81 % |
| EURIBOR - A LAS 11 HORAS | 26,41 % | 26,41 % |
| EURIBOR OFICIAL | 3,17 % | 3,17 % |
| I.R.P.H. CONJUNTO ENTIDADES | 0,46 % | 0,46 % |
| Otros | 0,15 % | 0,15 % |

| TIPO GARANTÍA | | | | |
|---------------|------------------|---------|------------------|---------|
| | Importe Actual | % | Importe Inicial | % |
| HIPOTECARIO | 521.045.579,45 | 25,23 % | 569.426.573,91 | 23,25 % |
| PERSONAL | 1.543.769.449,86 | 74,77 % | 1.880.127.024,23 | 76,75 % |
| TOTAL | 2.064.815.029,31 | | 2.449.553.598,14 | |

| MOROSIDAD ACTUAL / CURRENT DELINQUENCY | | | | | | |
|--|----------------|------------------|----------------------|--------------|--------------------------------|---------------|
| Antigüedad Deuda | Número Activos | Importe Impagado | | | Principal Pendiente no Vencido | Deuda Total |
| | | Principal | Intereses Ordinarios | Total | | |
| HASTA 1 MES | 210 | 265.884,62 | 12.571,74 | 278.456,36 | 3.697.840,74 | 3.976.297,10 |
| DE 1 A 2 MESES | 126 | 88.533,81 | 16.040,28 | 104.574,09 | 2.559.513,98 | 2.664.088,07 |
| DE 2 A 3 MESES | 47 | 40.749,54 | 2.943,43 | 43.692,97 | 1.024.835,22 | 1.068.528,19 |
| DE 3 A 6 MESES | 818 | 1.743.208,49 | 169.714,44 | 1.912.922,93 | 12.350.254,04 | 14.263.176,97 |
| DE 6 A 12 MESES | 382 | 655.980,04 | 90.398,37 | 746.378,41 | 4.079.521,51 | 4.825.899,92 |
| DE 12 A 18 MESES | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| DE 18 A 2 AÑOS | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| DE 2 A 3 AÑOS | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| MAS DE 3 AÑOS | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Totales | 1.583 | 2.794.356,50 | 291.668,26 | 3.086.024,76 | 23.711.965,49 | 26.797.990,25 |

Subordinación y Fondo de Reserva / Subordination and Reserve Fund

| Bonos Subordinados | Actual | | A la Emisión | |
|--------------------|--------|----------------|--------------|----------------|
| | % | Importe | % | Importe |
| | 14,31% | 318.500.000,00 | 13,00% | 318.500.000,00 |
| Fondo Reserva | 5,17% | 115.150.000,00 | 4,70% | 115.150.000,00 |

Otras Operaciones Financieras / Other Financial Operations

| Activo | Saldo Actual | Interés |
|-------------------------|----------------|-----------------|
| Cuenta Tesorería T.I.G. | 282.999.093,28 | Tipo Fijo 0,00% |

RESPONSABILIDAD CONTENIDO INFORMACION:

CAIXABANK TITULIZACION, S.G.F.T., S.A.U.

www.caixabanktitulizacion.com