



Informe de Auditoría de EBN Alpha Sector Privado, Fondo de Titulización

(Junto con las cuentas anuales e informe de gestión de EBN Alpha Sector Privado, Fondo de Titulización correspondientes al ejercicio finalizado el 31.12.2023)



KPMG Auditores, S.L.
Paseo de la Castellana, 259 C
28046 Madrid

Informe de Auditoría de Cuentas Anuales emitido por un Auditor Independiente

Al Consejo de Administración de EBN Titulización, S.A., Sociedad Gestora de Fondos de Titulización (la "Sociedad Gestora")

Opinión

Hemos auditado las cuentas anuales de EBN Alpha Sector Privado, Fondo de Titulización (el "Fondo"), que comprenden el balance a 31 de diciembre de 2023 agregado, la cuenta de pérdidas y ganancias agregada, el estado de flujos de efectivo agregado, el estado de ingresos y gastos reconocidos agregado y la memoria correspondientes al ejercicio terminado en dicha fecha, y los balances a 31 de diciembre de 2023 y las cuentas de pérdidas y ganancias, los estados de flujos de efectivo, los estados de ingresos y gastos reconocidos correspondientes al ejercicio terminado en dicha fecha de los dos compartimentos que forman el Fondo: Compartimento en Euros y Compartimento en Dólares.

En nuestra opinión, las cuentas anuales adjuntas expresan, en todos los aspectos significativos, la imagen fiel del patrimonio y de la situación financiera del Fondo a 31 de diciembre de 2023, así como de sus resultados correspondientes al ejercicio terminado en dicha fecha, de conformidad con el marco normativo de información financiera que resulta de aplicación (que se identifica en la nota 2 de la memoria) y, en particular, con los principios y criterios contables contenidos en el mismo.

Fundamento de la opinión

Hemos llevado a cabo nuestra auditoría de conformidad con la normativa reguladora de la actividad de auditoría de cuentas vigente en España. Nuestras responsabilidades de acuerdo con dichas normas se describen más adelante en la sección *Responsabilidades del auditor en relación con la auditoría de las cuentas anuales* de nuestro informe.

Somos independientes del Fondo de conformidad con los requerimientos de ética, incluidos los de independencia, que son aplicables a nuestra auditoría de las cuentas anuales en España según lo exigido por la normativa reguladora de la actividad de auditoría de cuentas. En este sentido, no hemos prestado servicios distintos a los de la auditoría de cuentas ni han concurrido situaciones o circunstancias que, de acuerdo con lo establecido en la citada normativa reguladora, hayan afectado a la necesaria independencia de modo que se haya visto comprometida.

Consideramos que la evidencia de auditoría que hemos obtenido proporciona una base suficiente y adecuada para nuestra opinión.



Aspectos más relevantes de la auditoría

Los aspectos más relevantes de la auditoría son aquellos que, según nuestro juicio profesional, han sido considerados como los riesgos de incorrección material más significativos en nuestra auditoría de las cuentas anuales del periodo actual. Estos riesgos han sido tratados en el contexto de nuestra auditoría de las cuentas anuales en su conjunto, y en la formación de nuestra opinión sobre éstas, y no expresamos una opinión por separado sobre esos riesgos.

Deterioro de los activos titulizados (véase nota 5 de la memoria)

La cartera de Activos Titulizados por importe de 21.407 miles de euros representa, al 31 de diciembre de 2023, la práctica totalidad del activo del Fondo a dicha fecha. El Fondo instrumenta dichos activos como colateral de los bonos de titulización emitidos. Dada la naturaleza y objeto específicos del Fondo, la amortización de los bonos en cada fecha de pago se determina en base a la disponibilidad de liquidez obtenida en función de los cobros de principal e intereses de los activos titulizados. Por tanto, a efectos de la amortización de los bonos, es necesario considerar cualquier corrección valorativa de los activos titulizados, basada en los criterios de estimación que se describen en la nota 3 de la memoria de las cuentas anuales adjuntas.

La estimación del deterioro de los Activos Titulizados conlleva un componente de juicio y dificultad técnica necesarios para la determinación de los parámetros a aplicar en el cálculo del deterioro. Por este motivo lo hemos considerado uno de los aspectos más relevantes de la auditoría.

Nuestro enfoque de auditoría ha incluido, tanto la revisión del proceso de estimación del deterioro de los Activos Titulizados, como la realización de procedimientos sustantivos sobre dicha estimación.

Asimismo, nuestros procedimientos sustantivos en relación con la estimación del deterioro de los Activos Titulizados han consistido básicamente en:

- Solicitud de confirmación a la entidad cedente sobre la existencia de los Activos Titulizados.
- Evaluación de la integridad y exactitud de los Activos Dudosos.
- Recálculo del deterioro de acuerdo a la normativa aplicable (Circular 2/2016, de 20 de abril, de la Comisión Nacional del Mercado de Valores).

Adicionalmente hemos evaluado si la información de las cuentas anuales en relación con el deterioro de los Activos Titulizados es adecuada de conformidad con el marco normativo de información financiera que resulta de aplicación.

Gestión de tesorería (véase notas 6 y 7 de la memoria)

De conformidad con la legislación vigente y con lo descrito en su escritura de constitución al momento de su constitución, el Fondo estima los flujos de caja de acuerdo a los cobros de principal e intereses de sus Activos Titulizados, así como también se estiman la amortización y pagos de los pasivos de acuerdo al orden de prelación de pagos establecida.



Debido a la complejidad asociada a las citadas estimaciones de los cobros de los Activos Titulizados y, de las estimaciones de las amortizaciones y pagos de los pasivos de acuerdo al orden de prelación de pagos establecida, la gestión de la tesorería se ha considerado uno de los aspectos más relevantes de la auditoría.

Nuestro enfoque de auditoría ha incluido tanto la revisión del proceso vinculado a los cobros y pagos estimados en la escritura de constitución de acuerdo con el orden de prelación de pagos, así como la realización de procedimientos sustantivos sobre el orden de prelación de pagos.

- Hemos obtenido un entendimiento de los procedimientos y criterios empleados por la Sociedad Gestora del Fondo, para el cumplimiento normativo de la escritura de constitución, al objeto de considerar que dichos criterios son adecuados y se aplican de manera consistente.
- Hemos revisado al 31 de diciembre de 2023 que el Fondo cumple con los supuestos establecidos en su escritura de constitución, contrastando dichas circunstancias con las registradas en contabilidad, considerando los cobros producidos y los pagos de los Pasivos del Fondo de acuerdo con el orden de prelación de pagos.

Otra información: Informe de gestión

La otra información comprende exclusivamente el informe de gestión del ejercicio 2023, cuya formulación es responsabilidad de los Administradores de la Sociedad Gestora del Fondo y no forma parte integrante de las cuentas anuales.

Nuestra opinión de auditoría sobre las cuentas anuales no cubre el informe de gestión. Nuestra responsabilidad sobre el informe de gestión, de conformidad con lo exigido por la normativa reguladora de la actividad de auditoría de cuentas, consiste en evaluar e informar sobre la concordancia del informe de gestión con las cuentas anuales, a partir del conocimiento del Fondo obtenido en la realización de la auditoría de las citadas cuentas anuales, así como evaluar e informar de si el contenido y presentación del informe de gestión son conformes a la normativa que resulta de aplicación. Si, basándonos en el trabajo que hemos realizado, concluimos que existen incorrecciones materiales, estamos obligados a informar de ello.

Sobre la base del trabajo realizado, según lo descrito en el párrafo anterior, la información que contiene el informe de gestión concuerda con la de las cuentas anuales del ejercicio 2023 y su contenido y presentación son conformes a la normativa que resulta de aplicación.



Responsabilidad de los Administradores en relación con las cuentas anuales

Los Administradores de la Sociedad Gestora son responsables de formular las cuentas anuales adjuntas, de forma que expresen la imagen fiel del patrimonio, de la situación financiera y de los resultados del Fondo, de conformidad con el marco normativo de información financiera aplicable al Fondo en España, y del control interno que consideren necesario para permitir la preparación de cuentas anuales libres de incorrección material, debida a fraude o error.

En la preparación de las cuentas anuales, los Administradores de la Sociedad Gestora son responsables de la valoración de la capacidad del Fondo para continuar como empresa en funcionamiento, revelando, según corresponda, las cuestiones relacionadas con la empresa en funcionamiento y utilizando el principio contable de empresa en funcionamiento excepto si los Administradores de la Sociedad Gestora tienen intención de liquidar el Fondo o de cesar sus operaciones, o bien no exista otra alternativa realista.

Responsabilidades del auditor en relación con la auditoría de las cuentas anuales

Nuestros objetivos son obtener una seguridad razonable de que las cuentas anuales en su conjunto están libres de incorrección material, debida a fraude o error, y emitir un informe de auditoría que contiene nuestra opinión. Seguridad razonable es un alto grado de seguridad pero no garantiza que una auditoría realizada de conformidad con la normativa reguladora de la actividad de auditoría de cuentas vigente en España siempre detecte una incorrección material cuando existe. Las incorrecciones pueden deberse a fraude o error y se consideran materiales si, individualmente o de forma agregada, puede preverse razonablemente que influyan en las decisiones económicas que los usuarios toman basándose en las cuentas anuales.

Como parte de una auditoría de conformidad con la normativa reguladora de la actividad de auditoría de cuentas vigente en España, aplicamos nuestro juicio profesional y mantenemos una actitud de escepticismo profesional durante toda la auditoría. También:

- Identificamos y valoramos los riesgos de incorrección material en las cuentas anuales, debida a fraude o error, diseñamos y aplicamos procedimientos de auditoría para responder a dichos riesgos y obtenemos evidencia de auditoría suficiente y adecuada para proporcionar una base para nuestra opinión. El riesgo de no detectar una incorrección material debida a fraude es más elevado que en el caso de una incorrección material debida a error, ya que el fraude puede implicar colusión, falsificación, omisiones deliberadas, manifestaciones intencionadamente erróneas, o la elusión del control interno de la Sociedad Gestora en relación al Fondo.
- Obtenemos conocimiento del control interno relevante para la auditoría con el fin de diseñar procedimientos de auditoría que sean adecuados en función de las circunstancias, y no con la finalidad de expresar una opinión sobre la eficacia del control interno de la Sociedad Gestora en relación al Fondo.
- Evaluamos si las políticas contables aplicadas son adecuadas y la razonabilidad de las estimaciones contables y la correspondiente información revelada por los Administradores de la Sociedad Gestora en relación al Fondo.

- Concluimos sobre si es adecuada la utilización, por los Administradores de la Sociedad Gestora, del principio contable de empresa en funcionamiento y, basándonos en la evidencia de auditoría obtenida, concluimos sobre si existe o no una incertidumbre material relacionada con hechos o con condiciones que pueden generar dudas significativas sobre la capacidad del Fondo para continuar como empresa en funcionamiento. Si concluimos que existe una incertidumbre material, se requiere que llamemos la atención en nuestro informe de auditoría sobre la correspondiente información revelada en las cuentas anuales o, si dichas revelaciones no son adecuadas, que expresemos una opinión modificada. Nuestras conclusiones se basan en la evidencia de auditoría obtenida hasta la fecha de nuestro informe de auditoría. Sin embargo, los hechos o condiciones futuros pueden ser la causa de que el Fondo deje de ser una empresa en funcionamiento.
- Evaluamos la presentación global, la estructura y el contenido de las cuentas anuales, incluida la información revelada, y si las cuentas anuales representan las transacciones y hechos subyacentes de un modo que logran expresar la imagen fiel.

Nos comunicamos con los Administradores de la Sociedad Gestora en relación con, entre otras cuestiones, el alcance y el momento de realización de la auditoría planificados y los hallazgos significativos de la auditoría, así como cualquier deficiencia significativa del control interno que identificamos en el transcurso de la auditoría.

Entre los riesgos significativos que han sido objeto de comunicación a los Administradores de la Sociedad Gestora de EBN Alpha Sector Privado, Fondo de Titulización, determinamos los que han sido de la mayor significatividad en la auditoría de las cuentas anuales del periodo actual y que son, en consecuencia, los riesgos considerados más significativos.

Describimos esos riesgos en nuestro informe de auditoría salvo que las disposiciones legales o reglamentarias prohíban revelar públicamente la cuestión.

KPMG Auditores, S.L.

Inscrito en el R.O.A.C. nº S0702

Juan Ignacio Llorente Pérez

Inscrito en el R.O.A.C. nº 20.412

23 de abril de 2024



KPMG AUDITORES, S.L.

2024 Núm. 01/24/07115

SELLO CORPORATIVO: 96,00 EUR

Informe de auditoría de cuentas sujeto a la normativa de auditoría de cuentas española o internacional



EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, Fondo de Titulización

Cuentas Anuales
31 de diciembre de 2023

Informe de Gestión
31 de diciembre de 2023

(Junto con el Informe de Auditoría)

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

ÍNDICE:

CUENTAS ANUALES

- Balances
 - o Balances del Compartimento en euros a 31 de diciembre de 2023 y 31 de diciembre de 2022
 - o Balances del Compartimento en dólares a 31 de diciembre de 2023 y 31 de diciembre de 2022
 - o Balances agregados a 31 de diciembre de 2023 y 31 de diciembre de 2022
- Cuentas de Pérdidas y Ganancias
 - o Cuentas de Pérdidas y Ganancias del Compartimento en euros correspondientes al ejercicio 2023 y 2022
 - o Cuentas de Pérdidas y Ganancias del Compartimento en dólares correspondientes al ejercicio 2023 y 2022
 - o Cuentas de Pérdidas y Ganancias agregadas correspondientes al ejercicio 2023 y 2022
- Estado de Flujos de Efectivo
 - o Estados de Flujos de Efectivo del Compartimento en euros correspondientes al ejercicio 2023 y 2022
 - o Estados de Flujos de Efectivo del Compartimento en dólares correspondientes al ejercicio 2023 y 2022
 - o Estados de Flujos de Efectivo agregado correspondientes al ejercicio 2023 y 2022
- Estado de Ingresos y Gastos Reconocidos
 - o Estados de Ingresos y Gastos Reconocidos del Compartimento en euros correspondientes al ejercicio 2023 y 2022
 - o Estados de Ingresos y Gastos Reconocidos del Compartimento en dólares correspondientes al ejercicio 2023 y 2022
 - o Estados de Ingresos y Gastos Reconocidos agregados correspondientes al ejercicio 2023 y 2022
- Memoria
- Informe de Gestión
- Anexo I: Estados S05.1, S05.2, S05.3, S05.4, S05.5 y S06

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Balances al 31 de diciembre de 2023 y 2022
Compartimento en euros
(Expresados en miles de euros)

	Nota	Miles de euros	
		31.12.2023	31.12.2022(*)
ACTIVO			
A) ACTIVO NO CORRIENTE			
I. Activos financieros a largo plazo		-	-
1. Activos titulizados		-	-
2. Derivados		-	-
3. Otros activos financieros		-	-
II. Activos por impuesto diferido		-	-
III. Otros activos no corrientes		-	-
B) ACTIVO CORRIENTE		537	6.157
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta		-	-
V. Activos financieros a corto plazo		524	6.148
1. Activos titulizados	5	524	6.148
Cuentas a cobrar		523	6.145
Intereses devengados no vencidos		1	3
2. Derivados		-	-
3. Otros activos financieros		-	-
VI. Ajustes por periodificaciones		-	-
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	6	13	9
1. Tesorería		13	9
2. Otros activos líquidos equivalentes		-	-
		537	6.157
TOTAL ACTIVO		537	6.157

(*) Se presenta, única y exclusivamente, a efectos comparativos.
La memoria adjunta forma parte integrante de las cuentas anuales de 2023.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Balances al 31 de diciembre de 2023 y 2022
Compartimento en euros
(Expresados en miles de euros)

	Nota	Miles de euros	
		31.12.2023	31.12.2022(*)
PASIVO			
A) PASIVO NO CORRIENTE		-	-
I. Provisiones a largo plazo		-	-
II. Pasivos financieros a largo plazo		-	-
1. Obligaciones y otros valores emitidos		-	-
Series no subordinadas		-	-
2. Deudas con entidades de crédito		-	-
3. Derivados		-	-
4. Otros pasivos financieros		-	-
III. Pasivos por impuesto diferido		-	-
B) PASIVO CORRIENTE		537	6.157
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta		-	-
V. Provisiones a corto plazo		-	-
VI. Pasivos financieros a corto plazo	7	537	6.150
1. Obligaciones y otros valores emitidos		531	6.146
Series no subordinadas		523	6.145
Intereses y gastos devengados no vencidos		-	1
2. Deudas con entidades de crédito		-	-
Préstamo Subordinado		-	-
3. Derivados		-	-
4. Otros pasivos financieros		8	4
Acreedores y otras cuentas a pagar		8	4
VII. Ajustes por periodificaciones	8	6	7
1. Comisiones		-	2
Comisión sociedad gestora		-	1
Comisión administrador		-	1
Comisión agente financiero / pagos		-	-
Comisión variable		-	-
Otras comisiones		-	-
2. Otros		6	5
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS		-	-
VIII. Activos financieros disponibles para la venta		-	-
IX. Coberturas de flujos de efectivo		-	-
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos		-	-
TOTAL PASIVO		537	6.157

(*) Se presenta, única y exclusivamente, a efectos comparativos.
La memoria adjunta forma parte integrante de las cuentas anuales de 2023.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Balances al 31 de diciembre de 2023 y 2022
Compartimento en dólares
(Expresados en miles de euros)

	Nota	Miles de euros	
		31.12.2023	31.12.2022(*)
ACTIVO			
A) ACTIVO NO CORRIENTE			
I. Activos financieros a largo plazo		-	-
1. Activos titulizados		-	-
2. Derivados		-	-
3. Otros activos financieros		-	-
II. Activos por impuesto diferido		-	-
III. Otros activos no corrientes		-	-
B) ACTIVO CORRIENTE		20.926	23.898
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta		-	-
V. Activos financieros a corto plazo		20.883	23.886
1. Activos titulizados	5	20.883	23.885
Cuentas a cobrar		20.618	23.855
Intereses devengados no vencidos		265	30
2. Derivados		-	-
3. Otros activos financieros		-	1
Deudores y otras cuentas a cobrar		-	1
VI. Ajustes por periodificaciones		-	-
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	6	43	12
1. Tesorería		43	12
2. Otros activos líquidos equivalentes		-	-
TOTAL ACTIVO		20.926	23.898

(*) Se presenta, única y exclusivamente, a efectos comparativos.
La memoria adjunta forma parte integrante de las cuentas anuales de 2023.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Balances al 31 de diciembre de 2023 y 2022
Compartimento en dólares
(Expresados en miles de euros)

	Nota	Miles de euros	
		31.12.2023	31.12.2022(*)
PASIVO			
A) PASIVO NO CORRIENTE		-	-
I. Provisiones a largo plazo		-	-
II. Pasivos financieros a largo plazo	7	-	-
1. Obligaciones y otros valores emitidos		-	-
Series no subordinadas		-	-
2. Deudas con entidades de crédito		-	-
3. Derivados		-	-
4. Otros pasivos financieros		-	-
III. Pasivos por impuesto diferido		-	-
B) PASIVO CORRIENTE		20.926	23.898
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta		-	-
V. Provisiones a corto plazo		-	-
VI. Pasivos financieros a corto plazo	7	20.825	23.870
1. Obligaciones y otros valores emitidos		20.646	23.870
Series no subordinadas		20.618	23.855
Intereses y gastos devengados no vencidos		28	15
2. Deudas con entidades de crédito		-	-
Préstamo Subordinado		-	-
3. Derivados		-	-
4. Otros pasivos financieros		179	-
Acreedores y otras cuentas a pagar		179	-
VII. Ajustes por periodificaciones	8	101	28
1. Comisiones		71	23
Comisión sociedad gestora		11	2
Comisión administrador		8	6
Comisión agente financiero / pagos		-	-
Comisión variable		52	14
Otras comisiones		-	1
2. Otros		30	5
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS		-	-
VIII. Activos financieros disponibles para la venta		-	-
IX. Coberturas de flujos de efectivo		-	-
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos		-	-
TOTAL PASIVO		20.926	23.898

(*) Se presenta, única y exclusivamente, a efectos comparativos.
La memoria adjunta forma parte integrante de las cuentas anuales de 2023.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Balances agregados al 31 de diciembre de 2023 y 2022
(Expresados en miles de euros)

	Nota	Miles de euros	
		31.12.2023	31.12.2022(*)
ACTIVO			
A) ACTIVO NO CORRIENTE			
I. Activos financieros a largo plazo		-	-
1. Activos titulizados		-	-
2. Derivados		-	-
3. Otros activos financieros		-	-
II. Activos por impuesto diferido		-	-
III. Otros activos no corrientes		-	-
B) ACTIVO CORRIENTE		21.463	30.055
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta		-	-
V. Activos financieros a corto plazo		21.407	30.034
1. Activos titulizados	5	21.407	30.033
Cuentas a cobrar		21.141	30.000
Intereses y gastos devengados no vencidos		266	33
Activos dudosos (Principal)		-	-
2. Derivados		-	-
3. Otros activos financieros		-	1
Deudores y otras cuentas a cobrar		-	1
VI. Ajustes por periodificaciones		-	-
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	6	56	21
1. Tesorería		56	21
2. Otros activos líquidos equivalentes		-	-
TOTAL ACTIVO		21.463	30.055

(*) Se presenta, única y exclusivamente, a efectos comparativos.
La memoria adjunta forma parte integrante de las cuentas anuales de 2023.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Balances agregados al 31 de diciembre de 2023 y 2022
(Expresados en miles de euros)

	Nota	Miles de euros	
		31.12.2023	31.12.2022(*)
PASIVO			
A) PASIVO NO CORRIENTE		-	-
I. Provisiones a largo plazo		-	-
II. Pasivos financieros a largo plazo	7	-	-
1. Obligaciones y otros valores emitidos		-	-
Series no subordinadas		-	-
2. Deudas con entidades de crédito		-	-
3. Derivados		-	-
4. Otros pasivos financieros		-	-
III. Pasivos por impuesto diferido		-	-
B) PASIVO CORRIENTE		21.463	30.055
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta		-	-
V. Provisiones a corto plazo		-	-
VI. Pasivos financieros a corto plazo	7	21.356	30.020
1. Obligaciones y otros valores emitidos		21.169	30.016
Series no subordinadas		21.141	30.000
Intereses y gastos devengados no vencidos		28	16
2. Deudas con entidades de crédito		-	-
Préstamo Subordinado		-	-
Crédito línea de liquidez dispuesta		-	-
3. Derivados		-	-
4. Otros pasivos financieros		187	4
Acreedores y otras cuentas a pagar		187	4
VII. Ajustes por periodificaciones	8	107	35
1. Comisiones		71	25
Comisión sociedad gestora		11	3
Comisión administrador		8	7
Comisión agente financiero / pagos		-	-
Comisión variable		52	14
Otras comisiones		-	1
2. Otros		36	10
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS		-	-
VIII. Activos financieros disponibles para la venta		-	-
IX. Coberturas de flujos de efectivo		-	-
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos		-	-
TOTAL PASIVO		21.463	30.055

(*) Se presenta, única y exclusivamente, a efectos comparativos.
La memoria adjunta forma parte integrante de las cuentas anuales de 2023.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Cuentas de Pérdidas y Ganancias correspondientes al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de
2023 y 2022

Compartimento en euros
(Expresadas en miles de euros)

	Nota	Miles de euros	
		2023	2022(*)
1. Intereses y rendimientos asimilados		100	514
Activos titulizados	5	100	514
Otros activos financieros		-	-
2. Intereses y cargas asimilados		(52)	(259)
Obligaciones y otros valores emitidos	7	(52)	(259)
Deudas con entidades de crédito		-	-
Otros pasivos financieros		-	-
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos efectivo (neto)		-	-
A) MARGEN DE INTERESES		48	255
4. Resultado de operaciones financieras (neto)		-	-
5. Diferencias de cambio (neto)		-	-
6. Otros ingresos de explotación		-	-
7. Otros gastos de explotación		(48)	(323)
Servicios exteriores		(12)	(9)
Servicios de profesionales independientes		(12)	(9)
Tributos		-	-
Otros gastos de gestión corriente	8	(36)	(314)
Comisión de sociedad gestora		(11)	(63)
Comisión administrador		(20)	(161)
Comisión del agente financiero/ pagos		-	-
Comisión variable		-	(64)
Otras comisiones del cedente		-	-
Otros gastos		(5)	(26)
8. Deterioro de activos financieros (neto)		-	-
9. Dotaciones a provisiones (neto)		-	-
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta		-	-
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	8	-	68
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS		-	-
12. Impuesto sobre beneficios		-	-
C) RESULTADO DEL PERIODO		-	-

(*) Se presenta, única y exclusivamente, a efectos comparativos.
La memoria adjunta forma parte integrante de las cuentas anuales de 2023.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Cuentas de Pérdidas y Ganancias correspondientes al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2023 y
2022

Compartimento en dólares
(Expresadas en miles de euros)

	Nota	Miles de euros	
		2023	2022(*)
1. Intereses y rendimientos asimilados		491	1.202
Activos titulizados	5	491	1.202
Otros activos financieros		-	-
2. Intereses y cargas asimilados		(274)	(604)
Obligaciones y otros valores emitidos	7	(274)	(604)
Deudas con entidades de crédito		-	-
Otros pasivos financieros		-	-
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos efectivo (neto)		-	-
A) MARGEN DE INTERESES		217	598
4. Resultado de operaciones financieras (neto)		-	-
5. Diferencias de cambio (neto)		(18)	-
6. Otros ingresos de explotación		-	-
7. Otros gastos de explotación		(199)	(719)
Servicios exteriores		(1)	(1)
Servicios de profesionales independientes		(1)	(1)
Servicios bancarios y similares		-	-
Tributos		-	-
Otros gastos de gestión corriente	8	(198)	(718)
Comisión de sociedad gestora		(42)	(151)
Comisión administrador		(130)	(376)
Comisión del agente financiero/ pagos		-	-
Comisión variable		-	(128)
Otras comisiones del cedente		-	-
Otros gastos		(26)	(63)
8. Deterioro de activos financieros (neto)		-	-
9. Dotaciones a provisiones (neto)		-	-
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta		-	-
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	8	-	121
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS		-	-
12. Impuesto sobre beneficios		-	-
C) RESULTADO DEL PERIODO		-	-

(*) Se presenta, única y exclusivamente, a efectos comparativos.

La memoria adjunta forma parte integrante de las cuentas anuales de 2023.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Cuentas de Pérdidas y Ganancias agregadas correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de
2023 y 2022
(Expresadas en miles de euros)

	Nota	Miles de euros	
		2023	2022(*)
1. Intereses y rendimientos asimilados		591	1.716
Activos titulizados	5	591	1.716
Otros activos financieros		-	-
2. Intereses y cargas asimilados		(326)	(863)
Obligaciones y otros valores emitidos	7	(326)	(863)
Deudas con entidades de crédito		-	-
Otros pasivos financieros		-	-
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos efectivo (neto)		-	-
A) MARGEN DE INTERESES		265	853
4. Resultado de operaciones financieras (neto)		-	-
5. Diferencias de cambio (neto)		(18)	-
6. Otros ingresos de explotación		-	-
7. Otros gastos de explotación		(247)	(1.042)
Servicios exteriores		(13)	(10)
Servicios de profesionales independientes		(13)	(10)
Servicios bancarios y similares		-	-
Tributos		-	-
Otros gastos de gestión corriente	8	(234)	(1.032)
Comisión de sociedad gestora		(53)	(214)
Comisión administrador		(150)	(537)
Comisión del agente financiero/ pagos		-	-
Comisión variable		-	(192)
Otras comisiones del cedente		-	-
Otros gastos		(31)	(89)
8. Deterioro de activos financieros (neto)		-	-
9. Dotaciones a provisiones (neto)		-	-
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta		-	-
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	8	-	189
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS		-	-
12. Impuesto sobre beneficios		-	-
C) RESULTADO DEL PERIODO		-	-

(*) Se presenta, única y exclusivamente, a efectos comparativos.
La memoria adjunta forma parte integrante de las cuentas anuales de 2023.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Estados de Flujos de Efectivo correspondientes al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2023 y 2022
Compartimento en euros
(Expresados en miles de euros)

	Miles de euros	
	2023	2022(*)
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN	13	40
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	60	302
Intereses cobrados de los activos titulizados	102	511
Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos (-)	(42)	(209)
Cobros por operaciones de derivados de cobertura	-	-
Pagos por operaciones de derivados de negociación (-)	-	-
Intereses cobrados de otros activos financieros	-	-
Intereses pagados por deudas con entidades de crédito (-)	-	-
Otros intereses cobrados/pagados (neto)	-	-
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados (-)	(47)	(262)
Comisión sociedad gestora (-)	(12)	(68)
Comisión administrador (-)	(30)	(169)
Comisión agente financiero/pagos (-)	-	-
Comisión variable (-)	-	-
Otras comisiones (-)	(5)	(25)
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	-	-
Pagos por garantías financieras (-)	-	-
Cobros por garantías financieras	-	-
Pagos por operaciones de derivados de cobertura (-)	-	-
Cobros por operaciones de derivados de negociación	-	-
Otros pagos de explotación (-)	-	-
Otros cobros de explotación	-	-
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION	(10)	(67)
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	18.739	98.994
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros (-)	(18.739)	(98.994)
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	-	-
Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	24.361	92.849
Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	-	-
Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	-	-
Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	-	-
Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	-	-
Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos (-)	(24.361)	(92.849)
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	(10)	(67)
Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	-	-
Pagos por amortización deudas con entidades de crédito (-)	-	-
Pagos a Administraciones públicas (-)	(21)	(174)
Otros cobros y pagos	11	107
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	4	(27)
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo.	9	36
Efectivo o equivalentes al final del periodo.	13	9

(*) Se presenta, única y exclusivamente, a efectos comparativos.
La memoria adjunta forma parte integrante de las cuentas anuales de 2023.

**EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN**

Estados de Flujos de Efectivo correspondientes al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2023 y 2022
Compartimento en dólares
(Expresados en miles de euros)

	Miles de euros	
	2023	2022(*)
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN	57	123
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	263	721
Intereses cobrados de los activos titulizados	471	1.215
Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos (-)	(208)	(495)
Cobros por operaciones de derivados de cobertura	-	-
Pagos por operaciones de derivados de negociación (-)	-	-
Intereses cobrados de otros activos financieros	-	-
Intereses pagados por deudas con entidades de crédito (-)	-	-
Otros intereses cobrados/pagados (neto)	-	1
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados (-)	(206)	(598)
Comisión sociedad gestora (-)	(50)	(154)
Comisión administrador (-)	(129)	(381)
Comisión agente financiero/pagos (-)	-	-
Comisión variable (-)	-	-
Otras comisiones (-)	(27)	(63)
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	-	-
Pagos por garantías financieras (-)	-	-
Cobros por garantías financieras	-	-
Pagos por operaciones de derivados de cobertura (-)	-	-
Cobros por operaciones de derivados de negociación	-	-
Otros pagos de explotación (-)	-	-
Otros cobros de explotación	-	-
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION	(25)	(119)
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	72.638	219.740
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros (-)	(72.423)	(219.737)
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	1.133	7
Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	75.603	206.523
Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	-	-
Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	-	-
Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	-	-
Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	-	-
Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos (-)	(74.470)	(206.516)
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	(1.373)	(129)
Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	-	-
Pagos por amortización deudas con entidades de crédito (-)	-	-
Pagos a Administraciones públicas (-)	-	-
Otros cobros y pagos	(1.373)	(129)
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	31	4
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo.	12	8
Efectivo o equivalentes al final del periodo.	43	12

(*) Se presenta, única y exclusivamente, a efectos comparativos.
La memoria adjunta forma parte integrante de las cuentas anuales de 2023.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Estados de Flujos de Efectivo agregados correspondientes al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de
2023 y 2022
(Expresados en miles de euros)

	Miles de euros	
	2023	2022(*)
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN	70	163
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	323	1.023
Intereses cobrados de los activos titulizados	573	1.726
Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos (-)	(250)	(704)
Cobros por operaciones de derivados de cobertura	-	-
Pagos por operaciones de derivados de negociación (-)	-	-
Intereses cobrados de otros activos financieros	-	-
Intereses pagados por deudas con entidades de crédito (-)	-	-
Otros intereses cobrados/pagados (neto)	-	1
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados (-)	(253)	(860)
Comisión sociedad gestora (-)	(62)	(222)
Comisión administrador (-)	(159)	(550)
Comisión agente financiero/pagos (-)	-	-
Comisión variable (-)	-	-
Otras comisiones (-)	(32)	(88)
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	-	-
Pagos por garantías financieras (-)	-	-
Cobros por garantías financieras	-	-
Pagos por operaciones de derivados de cobertura (-)	-	-
Cobros por operaciones de derivados de negociación	-	-
Otros pagos de explotación (-)	-	-
Otros cobros de explotación	-	-
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION	(35)	(186)
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	91.377	318.734
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros (-)	(91.162)	(318.731)
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	1.133	7
Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	99.964	299.372
Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	-	-
Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	-	-
Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	-	-
Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	-	-
Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos (-)	(98.831)	(299.365)
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	(1.383)	(196)
Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	-	-
Pagos por amortización deudas con entidades de crédito (-)	-	-
Pagos a Administraciones públicas (-)	(21)	(174)
Otros cobros y pagos	(1.362)	(22)
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	35	(23)
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo.	21	44
Efectivo o equivalentes al final del periodo.	56	21

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Estados de Ingresos y Gastos Reconocidos correspondientes al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de
2023 y 2022

Compartimento en euros
(Expresados en miles de euros)

	Miles de euros	
	2023	2022(*)
1. Activos financieros disponibles para la venta	-	-
1.1. Ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
1.1.1. Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
1.1.2. Efecto fiscal	-	-
1.2. Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	-	-
1.3. Otras reclasificaciones	-	-
1.4. Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	-	-
	-	-
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	-	-
2. Cobertura de los flujos de efectivo	-	-
2.1. Ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
2.1.1. Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
2.1.2. Efecto fiscal	-	-
2.2. Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	-	-
2.3. Otras reclasificaciones	-	-
2.4. Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	-	-
	-	-
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	-	-
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	-	-
3.1. Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance del periodo	-	-
3.1.1. Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
3.1.2. Efecto fiscal	-	-
3.2. Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	-	-
3.3. Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	-	-
	-	-
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	-	-
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	-	-

(*) Se presenta, única y exclusivamente, a efectos comparativos.

La memoria adjunta forma parte integrante de las cuentas anuales de 2023.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Estados de Ingresos y Gastos Reconocidos correspondientes al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de
2023 y 2022
Compartimento en dólares
(Expresados en miles de euros)

	Miles de euros	
	2023	2022(*)
1. Activos financieros disponibles para la venta	-	-
1.1. Ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
1.1.1. Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
1.1.2. Efecto fiscal	-	-
1.2. Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	-	-
1.3. Otras reclasificaciones	-	-
1.4. Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	-	-
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	-	-
2. Cobertura de los flujos de efectivo	-	-
2.1. Ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
2.1.1. Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
2.1.2. Efecto fiscal	-	-
2.2. Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	-	-
2.3. Otras reclasificaciones	-	-
2.4. Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	-	-
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	-	-
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	-	-
3.1. Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance del periodo	-	-
3.1.1. Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
3.1.2. Efecto fiscal	-	-
3.2. Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	-	-
3.3. Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	-	-
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	-	-
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	-	-

(*) Se presenta, única y exclusivamente, a efectos comparativos.
La memoria adjunta forma parte integrante de las cuentas anuales de 2023.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Estados de Ingresos y Gastos Reconocidos agregados correspondientes al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2023 y 2022
(Expresados en miles de euros)

	Miles de euros	
	2023	2022(*)
1. Activos financieros disponibles para la venta	-	-
1.1. Ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
1.1.1. Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
1.1.2. Efecto fiscal	-	-
1.2. Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	-	-
1.3. Otras reclasificaciones	-	-
1.4. Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	-	-
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	-	-
2. Cobertura de los flujos de efectivo	-	-
2.1. Ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
2.1.1. Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
2.1.2. Efecto fiscal	-	-
2.2. Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	-	-
2.3. Otras reclasificaciones	-	-
2.4. Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	-	-
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	-	-
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	-	-
3.1. Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance del periodo	-	-
3.1.1. Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
3.1.2. Efecto fiscal	-	-
3.2. Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	-	-
3.3. Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	-	-
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	-	-
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	-	-

(*) Se presenta, única y exclusivamente, a efectos comparativos.
La memoria adjunta forma parte integrante de las cuentas anuales de 2023.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

(1) Naturaleza y actividades principales

(a) Constitución y naturaleza jurídica

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, Fondo de Titulización (en adelante el Fondo) se constituyó mediante escritura pública el 12 de enero de 2021, con carácter de fondo abierto, dividido en dos compartimentos separados, uno destinado a la agrupación de los Derechos de Crédito en Dólares y el otro a la agrupación de los Derechos de Crédito en Euros, agrupando este último once derechos de crédito iniciales cedidos por ZEPA Finance, S.L. y EBN Titulización, S.A.U. por importe de 928.097,05 euros en la Fecha de Constitución del Fondo de Titulización y del Compartimento en Euros (véase nota 5).

La Sociedad Gestora, en nombre y representación del Fondo, procedió en la Fecha de Constitución del mismo a la emisión inicial en el Compartimento en euros de un Pagaré en euros, por un importe nominal total de 925.722,40 euros, con un precio de suscripción igual al 99,743% y cuya fecha de vencimiento del Pagaré fue el 15 de abril de 2021. El Compartimento en dólares no realizó ninguna emisión de Pagarés Iniciales en esta fecha de constitución. Posteriormente, en cada fecha de emisión, el Fondo podrá emitir nuevos Pagarés en euros, hasta alcanzar el importe máximo conjunto del programa.

Con fecha 29 de marzo de 2021, la Sociedad Gestora, en nombre y representación del Fondo, procedió a la firma de la escritura complementaria con motivo de la primera emisión en el Compartimento en dólares, la cual fue de un Pagaré cuyo precio de Emisión ascendió a 1.757.225,88 dólares, con un precio de suscripción igual al 99,566% y cuya fecha de vencimiento fue el 13 de julio de 2021. Posteriormente, en cada fecha de emisión, el Fondo podrá emitir nuevos Pagarés en dólares, hasta alcanzar el importe máximo conjunto del programa.

El Fondo es de carácter abierto tanto por su activo como por su pasivo y, en consecuencia, cada compartimento podrá emitir Pagarés y que se liquidarán de forma independiente de conformidad con las disposiciones establecidas en la Escritura de Constitución (véase nota 7).

El Fondo ha sido incorporado a los registros oficiales de la Comisión Nacional del Mercado de Valores con fecha 19 de enero de 2021 y de acuerdo con lo previsto en la Ley 5/2015, de 27 de abril, de fomento de la financiación empresarial, en la medida en que los Pagarés se dirigen exclusivamente a inversores cualificados.

Los Pagarés no cotizarán en ningún mercado secundario organizado. Los Pagarés Iniciales de ambos compartimentos fueron suscritos por la Entidad Suscriptora y Colocadora con fecha del 12 de enero de 2021 para el Compartimento en euros y 29 de marzo de 2021 para el Compartimento en Dólares. De conformidad con el artículo 22.4 de la Ley 5/2015, de 27 de abril, la circulación de los Pagarés será restringida a inversores cualificados. La Entidad Suscriptora y Colocadora es persona jurídica que no es una pequeña ni mediana empresa, con carácter de inversor cualificado.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

El Fondo se constituyó como un patrimonio separado, carente de personalidad jurídica, integrado, fundamentalmente, en cuanto a su activo, por los Derechos de Crédito Iniciales del Compartimento en euros (de carácter renovable y ampliable), en cuanto a su pasivo, por la emisión del Pagaré Inicial en Euros (previéndose la emisión sucesiva de valores) de tal forma que el valor patrimonial neto del fondo sea nulo.

La gestión y administración del Fondo está encomendada a EBN Titulización, S.A.U., S.G.F.T. (en adelante la Sociedad Gestora) con domicilio en Madrid, Paseo de Recoletos 29. Asimismo, en calidad de representante legal le corresponde la representación legal y defensa de los intereses de los titulares de los Pagarés emitidos con cargo al Fondo y de los restantes acreedores del mismo. La Sociedad Gestora figura inscrita en el registro especial de la Comisión Nacional del Mercado de Valores con el número 11.

(b) Duración

La actividad del Fondo se inició el día 12 de enero de 2021 y finalizará el 12 de enero de 2031 (Fecha de Vencimiento Final) salvo que con anterioridad se hubiera procedido a la liquidación anticipada del mismo.

Con fecha de 29 de marzo de 2021 se produce una escritura complementaria de cesión de Derechos de Crédito y primera emisión de Pagarés del Compartimento en Dólares no extintiva de la escritura.

Liquidación

El Fondo, y ambos compartimentos, se liquidarán en caso de producirse alguno de los siguientes supuestos (los "Supuestos de Liquidación del Fondo")

- (i) De acuerdo con lo previsto en el artículo 23.2 c) de la Ley 5/2015, cuando se hayan amortizado los Pagarés de ambos Compartimentos y no se fuera a realizar una emisión de Pagarés adicional de ninguno de los dos Compartimentos en un plazo de doce meses, previa confirmación por escrito del Cedente y de los Titulares de los Pagarés.
- (ii) De acuerdo con lo previsto en el artículo 23.2 a) de la Ley 5/2015, cuando el Fondo no tenga Derecho de Crédito Cedido alguno en ninguno de sus compartimentos en su haber y no se prevea, previa confirmación por escrito del Cedente, que fuera a adquirir Derechos de Crédito Adicionales de ninguno de los compartimentos en un plazo de dos meses.
- (iii) De acuerdo con el artículo 23.2 d) de la Ley 5/2015, obligatoriamente, en el supuesto de que la Sociedad Gestora fuera declarada en concurso y habiendo transcurrido el plazo que establece el artículo 33.2 de la Ley 5/2015 de cuatro meses, sin haber sido designada una nueva sociedad gestora.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

- (iv) Cuando, a juicio de la Sociedad Gestora, por razón de algún evento o circunstancia de cualquier índole ajena o no al desenvolvimiento propio del Fondo, incluidos los supuestos de modificación de la normativa fiscal vigente, se produjera una alteración sustancial o se desvirtuase de forma permanente el equilibrio financiero del Fondo. En este caso, la Sociedad Gestora, tras informar a la CNMV y a los Titulares de los Pagarés, procederá a la liquidación ordenada del Fondo.
- (v) En la Fecha de Vencimiento Final (inicial o la posteriormente determinada por acuerdo entre la Sociedad Gestora, el Cedente y los Titulares de los Pagarés).
- (vi) En el caso de que no fuera posible la sustitución del Administrador de Facturas cuando exista una previsión razonable de que el proceso de sustitución puede extenderse más de dos meses, o en el caso de que, una vez iniciado el proceso, éste se extienda en más de cuatro meses sin que haya sido posible culminarlo.
- (vii) En el caso de que la Escritura no fuera inscrita en el registro de CNMV en el plazo de un mes desde la fecha de su otorgamiento.
- (viii) Cuando se produzca un impago indicativo de un desequilibrio grave y permanente en relación con los Pagarés o se prevea que se vaya a producir.
- (ix) En el supuesto de que la Sociedad Gestora cuente con el consentimiento y la aceptación expresa de todos los Titulares de los Pagarés de ambos Compartimentos y del Cedente, tanto en relación con el pago de las cantidades correspondientes a la liquidación anticipada, así como en relación con el procedimiento de liquidación.

En todo caso, la Sociedad Gestora, actuando por cuenta y representación del Fondo, no procederá a la extinción del Fondo y a la cancelación de su inscripción en los registros administrativos que corresponda hasta que no haya procedido a la liquidación de los activos remanentes de ambos Compartimentos y haya aplicado el producto de dicha liquidación siguiendo el Orden de Prelación de Pagos, excepción hecha de la oportuna reserva para hacer frente a los gastos de extinción. La liquidación del Fondo se realizará en todo caso no más tarde de la Fecha de Vencimiento Final.

Extinción

El Fondo se extinguirá por cualquiera de las causas previstas en los apartados anteriormente descritos, en cuyo caso, la Sociedad Gestora informará a la CNMV y los Titulares de los Pagarés, e iniciará los trámites pertinentes para la extinción.

La Sociedad Gestora no procederá a la extinción del Fondo y a la cancelación de su inscripción en los registros administrativos que corresponda hasta que no haya liquidado los activos remanentes de cada Compartimento y distribuido sus fondos disponibles en cada Compartimento, siguiendo el Orden de Prelación de Pagos.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

La Sociedad Gestora procederá, dentro del año natural en que se proceda a la liquidación de los activos remanentes y la distribución de los fondos disponibles, o si la Sociedad Gestora lo estima conveniente, dentro de los tres primeros meses del ejercicio siguiente, a otorgar un acta notarial declarando: (i) la extinción del Fondo y las causas que la motivaron; (ii) el procedimiento de comunicación al Titular, o, en su caso, Titulares de los Pagarés y a la CNMV llevado a cabo; y (iii) la distribución de los Recursos Disponibles de cada Compartimento en la Fecha de Liquidación siguiendo el Orden de Prelación de Pagos de Liquidación previsto en la Escritura. Copia de dicha acta será remitida a la CNMV.

(c) Fechas de Pago y Recursos Disponibles del Fondo

A estos efectos, las "Fechas de Pago" del Fondo serán:

- (a) El último día Hábil de los meses de febrero, mayo, agosto y noviembre de cada año o, en caso de que alguno de estos días no fuera un Día Hábil, el siguiente Día Hábil. La Sociedad Gestora podrá sustituir dicho día por otro siempre que sea un Día Hábil y cuente con el acuerdo del Cedente, del Administrador de Facturas, de la Entidad Suscriptora y Colocadora y de los demás Titulares de los Pagarés. Dicha modificación, no podrá afectar al vencimiento de los Pagarés ya emitidos;
- (b) Cualquier día que sea una Fecha de Vencimiento Ordinario de un Pagaré; y
- (c) Cualquier Fecha de Vencimiento Prorrogado.

El abono de los intereses devengados de los Pagarés tendrá lugar siempre que el Fondo cuente con liquidez suficiente para ello en cada Fecha de Pago de acuerdo con el Orden de Prelación de Pagos.

Se define el Importe de Reembolso como la suma de los Valores Nominales de los Pagarés que vayan a vencer en una Fecha de Pago.

Los pagarés serán reembolsados por cada Compartimento en su respectiva fecha de vencimiento, y se efectuará con fecha valor ese mismo día. Cada Emisión de Pagarés deberá de especificar su Fecha de Vencimiento Ordinario. Los pagarés emitidos al amparo del Programa de Pagarés serán reembolsados por su Importe Nominal en la Fecha de Vencimiento Ordinario, indicada la retención a cuenta que corresponda y con sujeción al Orden de Prelación de Pagos.

Los Pagarés no incorporarán opción de amortización anticipada ni para el Fondo (call) ni para el titular del Pagaré (put) y, excepto en el supuesto de liquidación anticipada del Fondo o extinción del mismo, de acuerdo con lo establecido, los Pagarés emitidos al amparo del Programa de Pagarés no podrán amortizarse anticipadamente.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

En el caso de que, en la Fecha de Vencimiento Ordinario de cualesquiera Pagarés de un determinado Compartimento, cualquiera de los Derechos de Crédito Cedidos del Compartimento correspondiente se encontrase impagado y no hubiese recursos suficientes para atender el vencimiento correspondiente, el reembolso del Pagaré de dicho Compartimento cuya Fecha de Vencimiento Ordinario tuviera lugar en dicha Fecha de Pago se realizará como se establece a continuación:

- (1) Se reembolsarán en la Fecha de Vencimiento Ordinario mediante el reembolso parcial a prorrata de todos los Pagarés Prorrogados del Compartimento correspondiente que vencieran en dicha Fecha de Pago con el importe de los Recursos Disponibles de dicho Compartimento en dicha Fecha de Pago una vez aplicados los órdenes (i) a (iii) del Orden de Prelación de Pagos.
- (2) Posteriormente, una vez se hayan recobrado cualesquiera cantidades de los Derechos de Crédito Cedidos del Compartimento correspondiente de tal forma que se pueda disponer del mismo, la Sociedad Gestora procederá a aplicar inmediatamente el importe recuperado al reembolso a prorrata del importe de los Pagarés Prorrogados de dicho Compartimento.

Para cada Fecha de Pago durante el Período de Cesión, se determinarán como “Recursos Disponibles” las siguientes cantidades:

- (a) Los cobros correspondientes al Importe Financiado recibidos de los Derechos de Crédito Cedidos de dicho Compartimento que se encuentre depositados en la Cuenta de Tesorería correspondiente, o cualesquiera otras cantidades cobradas por el Fondo que traigan causa en los Derechos de Crédito Cedidos de dicho Compartimento y que se correspondan con los Costes de Cesión ya sean directamente o como consecuencia de reclamaciones judiciales, extrajudiciales, indemnizaciones o cualesquiera otras.
- (b) El importe de las remuneraciones de las Cuentas del Fondo del Compartimento correspondiente si fuera acordado dicha remuneración entre el Banco de Cuentas y la Sociedad Gestora, tal y como se indica en la Escritura.

(d) Orden de prelación de pagos de cada Compartimento

Los Recursos Disponibles de cada Compartimento se aplicarán, exclusivamente, al cumplimiento de las obligaciones de pago de dicho compartimento de acuerdo con el orden de prelación que se establece a continuación en cada Fecha de Pago:

- (i) Al pago de impuestos y al pago de gastos ordinarios o gastos extraordinarios de dicho Compartimento (excepto la Comisión de Administración de Facturas, que estará en el apartado (ii) del presente Orden de Prelación de Pagos, salvo que el Administrador de Facturas no sea Borrox Finance, en cuyo caso se incluirá el pago de su comisión en este apartado).
- (ii) Al pago de la Comisión de Administración de Facturas mientras esta función la siga desempeñando Borrox Finance.
- (iii) A la devolución de la Dotación para Gastos Ordinarios del Compartimento correspondiente.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

- (iv) A la amortización de los Pagarés del Compartimento correspondiente.
- (v) Durante el Periodo de Cesión, a redotar la Cuenta de Compras del Compartimento correspondiente por el importe remanente de los Recursos Disponibles, y una vez finalizado el Periodo de Cesión, al pago de la Comisión Variable del Compartimento correspondiente.

Otras reglas

En el supuesto de que las cantidades depositadas en la Cuenta de Tesorería de un Compartimento no fueran suficientes para abonar alguno de los importes mencionados en el apartado anterior, de acuerdo con la prelación de pagos del Compartimento correspondiente, se aplicarán las siguientes reglas:

- (i) El Compartimento hará frente a sus obligaciones, según el Orden de Prolación de Pagos establecido y, en el supuesto de que existan distintos acreedores del mismo rango, a prorrata del importe debido a cada uno.
- (ii) Los importes que queden impagados se situarán, en la siguiente Fecha de Pago, en un Orden de Prolación de Pagos inmediatamente anterior al del propio concepto del que se trate, antes de las cantidades de la misma naturaleza que de acuerdo con las disposiciones de la Escritura de Constitución deban ser pagadas en tal Fecha de Pago, pero por detrás del que le preceda según la prelación de pagos correspondiente.
- (iii) Las cantidades debidas por un Compartimento no satisfechas en sus respectivas Fechas de Pago no devengarán intereses adicionales.

(e) Gestión del Fondo

De acuerdo con la normativa legal aplicable a los fondos de titulización de activos y a las sociedades gestoras de los fondos de titulización, la gestión del Fondo está encomendada de forma exclusiva a Sociedades Gestoras de Fondos de Titulización, quienes a su vez tienen en este cometido su objeto social exclusivo.

EBN Titulización, Sociedad Anónima Unipersonal, S.G.F.T, actividad por la que recibe en cada Fecha de Pago, una comisión periódica que se devengará diariamente desde la constitución del Fondo hasta su extinción y que se liquidará y pagará por periodos vencidos en cada Fecha de Pago. Esta comisión de gestión será el resultante de sumar una comisión variable pagadera trimestralmente sobre el Saldo medio del Valor Nominal pendiente de los activos gestionados de cada Compartimento y el porcentaje de una comisión variable calculada sobre el saldo restante una vez satisfechos los gastos fijos del fondo.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

(f) Administrador de los Activos Titulizados

Borro Finance, S.L., como administrador de las facturas de las que se derivan los Activos Titulizados cedidos al Fondo en virtud del contrato de administración suscrito en fecha 12 de enero de 2021 entre el Cedente, la Sociedad Gestora en nombre y representación del Fondo y el Proveedor de Servicios de Administración. El Proveedor de Servicios de Administración percibe una comisión pagadera trimestralmente sobre el Saldo medio del Valor nominal pendiente de los activos gestionadas de cada Compartimento y una comisión variable calculada sobre el saldo restante una vez satisfechos los gastos fijos del Fondo.

(g) Comisión Variable

Una vez, terminado el Periodo de Cesión, el Cedente tendrá derecho a la Comisión Variable, la cual se devengará diariamente. La Comisión Variable de cada Compartimento se define como la diferencia entre (i) todos los ingresos que puedan derivarse de los Derechos de Crédito Cedidos de dicho Compartimento y cualquier otro que pudiera corresponderle al Compartimento; menos (ii) todos los gastos del Compartimento, incluidos los intereses de su financiación, los necesarios para su constitución y su funcionamiento, y la cobertura de cuantos impagos se produzcan en los Derechos de Crédito Cedidos que integran el activo del Compartimento. En la Fecha de Liquidación Anticipada, o, en su caso, en la Fecha de Vencimiento Final, se sumará, adicionalmente el importe remanente tras la liquidación de todas las obligaciones de pago del cada Compartimento.

En su caso, todos los tributos relativos a los pagos realizados en este concepto serán a cargo del Cedente como perceptor de la Comisión Variable. En el caso de que los pagos en cuestión den lugar a la repercusión obligatoria de cualquier tributo, el importe a satisfacer se reducirá en la medida necesaria para que, incrementado en el tributo a repercutir, se mantenga la contraprestación pactada, que se habrá de considerar a estos efectos como importe total incluidos cualesquiera tributos que pudieran ser repercutidos a cada Compartimento.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

(h) Normativa legal

La constitución del Fondo y la emisión de los Bonos con cargo al mismo se lleva a cabo al amparo de lo previsto en la Escritura de Constitución del Fondo así como en la legislación española, y en concreto de acuerdo con el régimen legal previsto en, (i) la Ley 5/2015, de 27 de abril, de fomento de la financiación empresarial y cualquiera disposiciones que la desarrollen (ii) Real Decreto Legislativo 4/2015, de 23 de octubre, por el que se aprueba el texto refundido de la Ley del Mercado de Valores, (iii) La Circular 2/2016, de 20 de abril, de la CNMV sobre normas contables, cuentas anuales, estados financieros públicos y estados reservados de información estadística de los fondos de titulización, esta Circular, que se publicó en el Boletín Oficial del Estado el 30 de abril de 2016 y entró en vigor el día siguiente a su publicación, derogó la Circular 2/2009, de 25 marzo, de la CNMV y sus sucesivas modificaciones, que regulaban los mismos aspectos, (iv) el Real Decreto 1310/2005, de 4 de noviembre, por el que se desarrolla parcialmente la Ley 24/1988, de 28 de julio, del Mercado de Valores, en materia de admisión y negociación de valores en mercados secundarios oficiales, de ofertas públicas de venta o suscripción y del folleto exigible a tales efectos (el “Real Decreto 1310/2005”) (v) Demás disposiciones legales y reglamentarias en vigor en cada momento que resulten de aplicación.

(i) Régimen de tributación

De acuerdo con lo establecido en el artículo 7.1.h) de la Ley 27/2014, de 27 de noviembre, del Impuesto sobre Sociedades (“Ley del IS”); el artículo 20.Uno.18 de la Ley 37/1992, de 28 de diciembre, del Impuesto sobre el Valor Añadido, modificada por la Ley 28/2014, de 27 de noviembre; el artículo 61.k del Real Decreto 634/2015, de 10 de julio, por el que se aprueba el Reglamento del Impuesto sobre Sociedades (“Reglamento del IS”), las características propias del régimen fiscal vigente del Fondo son las siguientes:

- (i) La constitución y extinción del Fondo, así como todas las operaciones sujetas a la modalidad de “operaciones societarias” del Impuesto sobre Transmisiones Patrimoniales y Actos Jurídicos Documentados, está exenta del concepto “operaciones societarias” del Impuesto sobre Transmisiones Patrimoniales y Actos Jurídicos Documentados.
- (ii) La emisión de Pagarés está exenta del Impuesto sobre el Valor Añadido (artículo 20. Uno. 18º de la Ley del IVA) y del Impuesto sobre Transmisiones Patrimoniales y Actos Jurídicos Documentados (artículo 45-I. B 20.4 del Real Decreto Legislativo 1/1993, por el que se aprueba el Texto Refundido del Impuesto sobre Transmisiones Patrimoniales y Actos Jurídicos Documentados).
- (iii) El Fondo está sujeto al Impuesto sobre Sociedades (“IS”), determinando su base imponible conforme a lo dispuesto en el Título IV de la Ley del IS, y siendo de aplicación el tipo general vigente en cada momento, que se encuentra fijado en el veinticinco por ciento (25%).
- (iv) Los servicios de gestión prestados al Fondo por la Sociedad Gestora están exentos del Impuesto sobre el Valor Añadido.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

- (v) Respecto a los rendimientos de los Derechos de Crédito Cedidos u otros derechos que constituyan ingresos del Fondo, no existirá obligación de retener ni de ingresar a cuenta del Impuesto de Sociedades.

(2) Bases de presentación

(a) Imagen Fiel

En cumplimiento de la legislación vigente, el Consejo de Administración de EBN Titulización, S.A.U., S.G.F.T ha formulado estas cuentas anuales en su reunión celebrada el 20 de marzo de 2024. Estas cuentas, serán aprobadas por el mismo órgano, estimándose su aprobación sin cambios significativos.

Las Cuentas Anuales se han obtenido de los registros contables del Fondo y, junto con el Informe de gestión, han sido formuladas aplicando las normas y principios contables contenidos en la Circular 2/2016, de 20 de abril, de la Comisión Nacional del Mercado de Valores, de forma que muestran la imagen fiel de la situación financiera del Fondo al 31 de diciembre de 2023 y de los resultados de sus operaciones y de los flujos de efectivo que se han generado durante el ejercicio terminado en esa fecha.

Las Cuentas Anuales comprenden el balance, la cuenta de pérdidas y ganancias, el estado de flujos de efectivo, el estado de ingresos y gastos reconocidos y la memoria, de la que forman parte los estados financieros públicos S.05.1, S.05.2, S.05.3, S.05.4, S.05.5 y el apartado correspondiente a las notas explicativas del estado S.06 que se recogen como Anexo I.

Con fecha 28 de marzo de 2023, las Cuentas Anuales correspondientes al 31 de diciembre 2022 fueron formuladas por el Consejo de Administración de la Sociedad Gestora.

Considerando la magnitud de las cifras que aparecen en estas cuentas anuales, los Administradores de la Sociedad Gestora del Fondo han formulado las mismas incluyendo los valores en miles de euros.

(b) Comparación de la información

Los Administradores de la Sociedad Gestora presentan a efectos comparativos, con cada una de las cifras que se desglosan en las presentes cuentas anuales, además de las cifras del periodo anual terminado el 31 de diciembre de 2023, las correspondientes al ejercicio 2022. La información contenida en esta memoria referida al ejercicio de 2022 se presenta exclusivamente, a efectos comparativos y, por consiguiente, no constituye las cuentas anuales del Fondo del ejercicio acabado el 31 de diciembre de 2022.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

(c) Utilización de juicios y estimaciones en la elaboración de los estados financieros

En la preparación de las Cuentas Anuales del Fondo, los Administradores de la Sociedad Gestora han tenido que realizar juicios, estimaciones y asunciones que afectan a la aplicación de las políticas contables y a los saldos de los activos, pasivos, ingresos, gastos y compromisos existentes en la fecha de emisión de las presentes Cuentas Anuales.

Las estimaciones y asunciones realizadas están basadas en la experiencia histórica y en otros factores diversos que son entendidos como razonables de acuerdo con las circunstancias y cuyos resultados constituyen la base para establecer los juicios sobre el valor contable de los activos y pasivos que no son fácilmente disponibles mediante otras fuentes. Las estimaciones y las asunciones son revisadas de forma continuada. Sin embargo, la incertidumbre inherente a las estimaciones y asunciones podría conducir a resultados que podrían requerir ajuste de valores de los activos y pasivos afectados. Si como consecuencia de estas revisiones o de hechos futuros se produjese un cambio en dichas estimaciones, su efecto se registraría en las Cuentas Anuales de ese período y de periodos sucesivos.

(d) Agrupación de partidas

En la confección de estas Cuentas Anuales no se ha procedido a la agrupación de partidas relativas al balance, cuenta de pérdidas y ganancias, estado de flujos de efectivo y estado de ingresos y gastos reconocidos.

(e) Elementos recogidos en varias partidas

En la confección de estas Cuentas Anuales no se han registrado elementos patrimoniales en dos o más partidas del balance.

(f) Principios contables no obligatorios

En la preparación de las presentes Cuentas Anuales, los Administradores de la Sociedad Gestora no han utilizado ningún principio contable no obligatorio.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

(g) Moneda funcional y moneda de presentación

Las cuentas anuales, salvo mención en contrario, se presentan en euros, siendo el euro la moneda de presentación del Fondo. Consecuentemente, todos los saldos y transacciones denominados en monedas diferentes al euro se consideran denominados en moneda extranjera. No obstante, la moneda funcional del compartimento en dólares es el dólar estadounidense, debido a que la mayoría de las transacciones y operaciones realizadas por este compartimento del Fondo durante el ejercicio 2023 y 2022 han sido realizadas en esta moneda.

(h) Corrección de errores

En la elaboración de estas cuentas anuales no se ha puesto de manifiesto ningún error significativo que haya supuesto la reexpresión de los importes incluidos en las cuentas anuales del ejercicio acabado el 31 de diciembre de 2022.

(i) Impacto medioambiental

Dada la actividad a la que se dedica el Fondo, éste no tiene responsabilidades, gastos, activos, ni provisiones o contingencias de carácter medioambiental que pudieran ser significativos en relación con la situación financiera y los resultados del mismo. Por este motivo, no se incluyen desgloses específicos en la presente memoria respecto a información de cuestiones medioambientales.

(j) Empresa en Funcionamiento

El Consejo de Administración EBN Titulización, S.A.U., S.G.F.T. ha considerado que la gestión del Fondo continuará en un futuro previsible, por lo que la aplicación de los principios y criterios contables no tiene como propósito el determinar el valor del patrimonio neto a efectos de su transmisión global o parcial, ni el importe resultante en caso de su liquidación total.

(k) Cambios en criterios contables

Durante el ejercicio acabado el 31 de diciembre de 2023 no se han producido cambios de criterios contables significativos respecto a los criterios aplicados en el ejercicio acabado el 31 de diciembre de 2022.

(3) Principios contables y normas de valoración

Las Cuentas Anuales han sido formuladas siguiendo los principios y normas de valoración contenidas en la Circular 2/2016, de 20 de abril, de la Comisión Nacional del Mercado de Valores.

Los principales criterios de valoración seguidos en la elaboración de las Cuentas Anuales adjuntas han sido los siguientes:

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

(a) Reconocimiento de ingresos y gastos

Los ingresos y gastos se reconocen por el Fondo siguiendo el criterio del devengo, es decir, en función de la corriente real que los mismos representan, con independencia del momento en el que se produzca el cobro o pago de los mismos, siempre que su cuantía pueda determinarse con fiabilidad.

(b) Corriente y No Corriente

Se corresponden con activos y pasivos corrientes aquellos elementos cuyo vencimiento total o parcial, enajenación o realización, se espera que se produzca en un plazo máximo de un año a partir de la fecha del balance, clasificándose el resto como no corrientes.

(c) Activos dudosos

El valor en libros de los epígrafes de “Activos dudosos” recogerá el importe total de los instrumentos de deuda y Activos Titulizados que cuenten con algún importe vencido por principal, intereses o gastos pactados contractualmente, con más de tres meses de antigüedad, así como aquéllos que presentan dudas razonables sobre su reembolso total (principal e intereses) en los términos pactados contractualmente.

Se consideran “Activos Fallidos” aquellos activos titulizados, vencidos o no, para los que después de un análisis individualizado se considera remota su recuperación y procede darlos de baja del activo.

(d) Gastos de constitución y de emisión de Pagarés

Los gastos derivados del otorgamiento y ejecución de esta Escritura, los honorarios notariales y de asesores legales, serán por cuenta de Borrox, y el resto de los Gastos Iniciales serán a cargo del Cedente. Estos gastos han sido registrados por el importe real incurrido.

En la fecha de constitución del Fondo, los Gastos Iniciales, conjuntos para ambos Compartimentos, se pagaron con cargo a una dotación a fondo perdido realizada por el Cedente en la Cuenta de Tesorería del Compartimento en Euros por un importe de 5.100,50 euros.

(e) Activos financieros

Los activos financieros se reconocen en el balance cuando el Fondo se convierte en una parte obligada del contrato o negocio jurídico conforme a las disposiciones del mismo.

(f) Préstamos y partidas a cobrar

En esta categoría se clasifican aquellos activos financieros que, no siendo instrumentos de patrimonio ni derivados, sus cobros son de cuantía determinada o determinable y no se negocian en un mercado activo.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

En esta categoría se incluyen los activos titulizados que dispone el Fondo en cada momento.

Valoración inicial

Los activos financieros incluidos en esta categoría se valoran inicialmente por su valor razonable. Este valor razonable es el precio de la transacción, que equivaldrá al valor razonable de la contraprestación entregada más los costes de transacción que les sean directamente atribuibles.

No obstante, lo señalado en el párrafo anterior las cuentas a cobrar cuyo importe se espera recibir en el corto plazo, se valoran por su valor nominal cuando el efecto de no actualizar los flujos de efectivo no sea significativo.

Valoración posterior

Los activos financieros incluidos en esta categoría se valoran por su coste amortizado. Los intereses devengados se contabilizarán en la cuenta de pérdidas y ganancias, aplicando el método del tipo de interés efectivo.

(g) Pasivos financieros

Los instrumentos financieros emitidos, incurridos o asumidos por el Fondo se clasifican como pasivos financieros siempre que, de acuerdo con su realidad económica, supongan para éste una obligación contractual, directa o indirecta, de entregar efectivo u otro activo financiero, o de intercambiar activos o pasivos financieros con terceros en condiciones potencialmente desfavorables.

(h) Débitos y partidas a pagar

En esta categoría se clasifican, principalmente, aquellos pasivos financieros emitidos por el Fondo, con el fin de financiar la adquisición de activos financieros, es decir, los Pagarés de titulización emitidos por el Fondo.

Adicionalmente, se registran en esta categoría las deudas con entidades de crédito que hubieren sido contraídas con el fin de financiar la actividad del Fondo, así como cualquier disposición realizada de líneas de crédito concedidas al Fondo.

Valoración inicial

Los pasivos financieros incluidos en esta categoría se valoran inicialmente por su valor razonable, que, salvo evidencia en contrario, será el precio de la transacción, que equivaldrá al valor razonable de la contraprestación recibida ajustado por los costes de transacción que les sean directamente atribuibles.

No obstante, los débitos con vencimiento no superior a tres meses y que no tengan un tipo de interés contractual, cuyo importe se espera pagar en el corto plazo, se podrán valorar por su valor nominal, cuando el efecto de no actualizar los flujos de efectivo sea totalmente inmaterial. En estos casos no se registrarán ingresos o gastos por los intereses devengados.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

Valoración posterior

Los pasivos financieros incluidos en esta categoría se valoran por su coste amortizado. Los intereses devengados se contabilizan en la cuenta de pérdidas y ganancias, aplicando el método del tipo de interés efectivo.

No obstante, lo anterior, los débitos con vencimiento no superior a tres meses que, de acuerdo con lo dispuesto en el apartado anterior, se valoren inicialmente por su valor nominal, continuarán valorándose por dicho importe.

Repercusión de pérdidas a los pasivos financieros

Las pérdidas incurridas en el periodo son repercutidas a los pasivos emitidos por el Fondo, comenzando por la cuenta de periodificación del margen de intermediación financiera, devengada y no liquidada en periodos anteriores, y continuando por el pasivo más subordinado, teniendo en cuenta el orden inverso de prelación de pagos establecido contractualmente para cada fecha de pago.

Dicha repercusión se registra como un ingreso en la partida “Repercusión de pérdidas (ganancias)” en la cuenta de pérdidas y ganancias.

El importe correspondiente a las pérdidas a repercutir a un pasivo financiero es la diferencia entre su valor en libros y el valor actual de los flujos de efectivo futuros estimados y se presenta separadamente en el balance en las correspondientes partidas específicas de “Correcciones de valor por repercusión de pérdidas”.

En el cálculo del valor actual de los flujos de efectivo futuros estimados se utiliza como tipo de actualización el tipo de interés efectivo original del instrumento, si su tipo contractual es fijo, o el tipo de interés efectivo a la fecha a que se refieran los estados financieros, determinado de acuerdo con las condiciones del contrato, cuando sea variable.

La reversión de las pérdidas repercutidas a los pasivos financieros, que se produzca cuando el Fondo obtenga beneficios en el periodo se realiza en el orden inverso al establecido anteriormente para la repercusión de pérdidas, terminando por el margen de intermediación financiera periodificada.

Dicha reversión se registra como un gasto en la partida “Repercusión de pérdidas (ganancias)” en la cuenta de pérdidas y ganancias, y tiene como límite el valor en libros de los pasivos financieros que estaría reconocido en la fecha de reversión si no se hubiese realizado la repercusión de pérdidas.

Cancelación

La cancelación o baja del pasivo se podrá realizar, una vez dado de baja el activo afectado.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

(i) Intereses y gastos devengados no vencidos

En este epígrafe del activo se incluye la periodificación de los ingresos financieros derivados de los Activos titulizados, determinados de acuerdo con el tipo de interés efectivo, que aún no han sido cobrados.

Así mismo en el epígrafe del pasivo se incluye la periodificación de los costes financieros derivados de los Pagarés, que aún no han sido pagados, calculados de acuerdo con el tipo de interés efectivo.

(j) Ajustes por periodificación

Corresponden, principalmente, a la periodificación realizada de las comisiones devengadas por terceros, registrándose por su valor real en función de cada uno de los contratos suscritos, todos ellos en relación con la administración financiera y operativa del Fondo.

(k) Impuesto sobre Sociedades

El Fondo tributa en el régimen general del Impuesto sobre Sociedades de acuerdo con lo dispuesto por la Ley 27/2014, de 27 de noviembre, que establece el tipo de gravamen general del Impuesto sobre Sociedades en el 25%.

El gasto o ingreso por impuesto sobre beneficios comprende la parte relativa al gasto o ingreso por el impuesto corriente y la parte correspondiente al gasto o ingreso por el impuesto diferido, en su caso.

Dado que en el ejercicio 2023 y 2022 se han equilibrado los ingresos y los gastos del Fondo, no procede liquidar cuota alguna por el Impuesto sobre Beneficios (véase nota 9).

(l) Deterioro del valor de los activos financieros

El valor en libros de los activos financieros del Fondo es corregido por la Sociedad Gestora con cargo a la cuenta de pérdidas y ganancias cuando existe una evidencia objetiva de que se ha producido una pérdida por deterioro. De forma simétrica se reconoce en los pasivos financieros, y atendiendo al clausulado de la Escritura de constitución del Fondo, una reversión en el valor de los mismos con abono en la cuenta de pérdidas y ganancias.

El importe de las pérdidas por deterioro incurridas en los instrumentos de deuda valorados por su coste amortizado es igual a la diferencia entre su valor en libros y el valor actual de sus flujos de efectivo futuros estimados, excluyendo, en dicha estimación, las pérdidas crediticias futuras en las que no se haya incurrido.

Los flujos de efectivo futuros estimados de un instrumento de deuda son todos los importes, principal e intereses, que la Sociedad Gestora estima que el Fondo obtiene durante la vida del instrumento. En su estimación se considera toda la información relevante que esté disponible en la fecha de formulación de los estados financieros, que proporcione datos sobre la posibilidad de cobro futuro de los flujos de efectivo contractuales.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

En la estimación de los flujos de efectivo futuros de instrumentos que cuenten con garantías reales, siempre que éstas se hayan considerado en la cesión del instrumento o figuren en la información facilitada al titular de los pasivos emitidos por el Fondo, se tienen en cuenta los flujos que se obtendrían de su realización, menos el importe de los costes necesarios para su obtención y posterior venta, con independencia de la probabilidad de la ejecución de la garantía.

En el cálculo del valor actual de los flujos de efectivo futuros estimados se utiliza como tipo de actualización el tipo de interés efectivo original del instrumento, si su tipo contractual es fijo, o el tipo de interés efectivo a la fecha que se refieran los estados financieros, determinado de acuerdo con las condiciones del contrato, cuando sea variable.

Cuando se renegocian o modifican las condiciones de los instrumentos de deuda se utiliza el tipo de interés efectivo antes de la modificación del contrato, salvo que pueda probarse que dicha renegociación o modificación se produce por causa distinta a las dificultades financieras del prestatario o emisor.

El descuento de los flujos de efectivo no es necesario realizarlo cuando su impacto cuantitativo no es material. En particular, cuando el plazo previsto para el cobro de los flujos de efectivo es igual o inferior a tres meses.

En el cálculo de las pérdidas por deterioro de un grupo de activos financieros se pueden utilizar modelos basados en métodos estadísticos.

No obstante, el importe de la provisión que resulta de la aplicación de lo previsto en los párrafos anteriores no puede ser inferior a la que obtenga de la aplicación para los activos dudosos de los porcentajes mínimos de cobertura por calendario de morosidad que se indican en los siguientes apartados, que calculan las pérdidas por deterioro en función del tiempo transcurrido desde el vencimiento de la primera cuota o plazo que permanezca impagado de una misma operación:

- Tratamiento general

	(%)
Hasta 6 meses	25
Más de 6 meses, sin exceder de 9	50
Más de 9 meses, sin exceder de 12	75
Más de 12 meses	100

La escala anterior también se aplica, por acumulación, al conjunto de operaciones que el Fondo mantiene con un mismo deudor, en la medida que en cada una presente impagos superiores a tres meses. A estos efectos, se considera como fecha para el cálculo del porcentaje de cobertura la del importe vencido más antiguo que permanezca impagado, o la de la calificación de los activos como dudosos si es anterior.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

(m) Activos Titulizados

Los Derechos de Crédito Cedidos de ambos Compartimentos, tanto Iniciales como Adicionales, que se agruparán en el activo del Fondo consisten en derechos de cobro derivados de las Facturas y de los Contratos de Cesión, denominados en Dólares americanos en el caso de los Derechos de Crédito en Dólares y denominados en Euros en el caso de los Derechos de Crédito cedidos en Euros. Dichas Facturas han sido emitidas por diversos Proveedores (salvo en el caso de los pagarés, que son emitidos por el deudor correspondiente a la orden del Proveedor), con motivo de la prestación de servicios o entrega de bienes al amparo de relaciones comerciales propias del sector de actividad al que pertenezcan. Todos los deudores de las Facturas cedidas al Fondo (los “Deudores”) son entidades del grupo TÉCNICAS REUNIDAS, S.A.

Dado que las Facturas son previamente cedidas al Cedente en virtud del correspondiente Contrato de Cesión, los Derechos de Crédito Cedidos comprenden igualmente los derechos que ostenta el Cedente respecto de cada Proveedor, derivados de los Contratos de Cesión, y están limitados a los términos y condiciones en los que se realiza dicha cesión original. A efectos aclaratorios, se indica que, en los Contratos de Cesión, los Proveedores se denominan “cedentes” y el Cedente se denomina “cesionario”.

En particular, en virtud de los correspondientes Contratos de Cesión, cada Proveedor cede al Cedente el Importe Financiado de la correspondiente Factura, es decir, el valor nominal de la Factura. La Cantidad Descontada es el precio que paga el Cedente al Proveedor por cada Factura, equivalente al valor nominal consignado en la Factura menos los Costes de Cesión.

En el caso de Facturas que sean cedidas al Fondo por el Cedente, los Costes de la Cesión serán, como mínimo, del 1,50% anual, a prorrata del número de días financiados, calculados sobre una base de 365 días.

Los cobros procedentes de los Derechos de Crédito Cedidos se ingresarán en la Cuenta de Cobros del Compartimento correspondiente.

(n) Transacciones en moneda extranjera

La moneda funcional del Fondo es el Euro (para el compartimento en euros) y el Dólar estadounidense (para el compartimento en dólares), siendo su presentación siempre en euros.

(o) Compensación de saldos

Se compensan entre sí y, consecuentemente, se presentan en el balance por su importe neto— los saldos deudores y acreedores con origen en transacciones que, contractualmente o por imperativo de una norma legal, contemplan la posibilidad de compensación; teniendo la intención de liquidarlos por su importe neto o de realizar el activo y proceder al pago del pasivo de forma simultánea y en los que una de las partes contratantes sea una entidad financiera.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

(p) Estado de Flujos de Efectivo

En los estados de flujos de efectivo se utilizan las siguientes expresiones:

- Flujos de efectivo: entradas y salidas de dinero en efectivo y de sus equivalentes; entendiéndose por éstos las inversiones a corto plazo de gran liquidez y bajo riesgo de alteraciones en su valor.
- Actividades de explotación: son aquellas que constituyen la principal fuente de los ingresos ordinarios del Fondo, así como otras actividades que no pueden ser calificadas como de inversión o de financiación.
- Actividades de inversión y financiación: las de adquisición, enajenación o disposición por otros medios de activos a largo plazo y otras inversiones no incluidas en el efectivo y sus equivalentes, así como aquellas actividades que producen cambios en el tamaño y composición de los activos y pasivos que no forman parte de las actividades de explotación.

A efectos de la elaboración de los estados de flujos de efectivo, se han considerado como “efectivo o equivalentes de efectivo” aquellas inversiones a corto plazo de gran liquidez y con bajo riesgo a cambios en su valor. De esta manera, el Fondo considera efectivo o equivalentes de efectivo al saldo mantenido en cuentas corrientes y, en su caso, en adquisiciones temporales de activos, que se encuentra registrado en el epígrafe “Efectivo y otros activos líquidos equivalentes” del activo del balance.

(q) Estado de Ingresos y Gastos Reconocidos

Este estado recoge los ingresos y gastos generados por el Fondo que, de acuerdo con lo dispuesto en la normativa vigente, han sido registrados directamente en el capítulo “Ajustes repercutidos en balance de ingresos y gastos reconocidos” del pasivo del balance.

Por tanto, en este estado se presentan, en su caso:

- a) Los ingresos y gastos que, según lo requerido por las normas de valoración, deban imputarse directamente al pasivo del balance.
- b) Las transferencias realizadas, en su caso, a la cuenta de pérdidas y ganancias, según lo dispuesto en las normas de valoración adoptadas.
- c) El efecto impositivo correspondiente, en su caso, a los apartados a) y b) anteriores.
- d) El importe neto repercutido en el periodo a las cuentas correspondientes de pasivo, de forma que el total de ingresos y gastos reconocidos sea nulo.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

(4) Riesgos asociados a instrumentos financieros

Las actividades del Fondo están expuestas a diversos riesgos financieros: riesgo de liquidez, de concentración, riesgo de crédito, riesgo de reinversión, riesgo de insolvencia y riesgo de personalidad jurídica. La Sociedad Gestora los identifica, mide y hace un seguimiento continuo de los mismos de conformidad con lo establecido en la Escritura de Constitución.

Riesgo de liquidez

Este riesgo refleja la posible dificultad del Fondo para disponer de fondos líquidos, o para poder acceder a ellos, en la cuantía suficiente y al coste adecuado, de forma que pueda hacer frente en todo momento a sus obligaciones de pago conforme al calendario de pago establecido en la escritura del Fondo.

En la nota 5 se indica el desglose de los activos financieros por plazos residuales de vencimiento al 31 de diciembre de 2023. Las fechas de vencimiento que se han considerado para la construcción de las tablas son las fechas de vencimiento o cancelación contractual. Los importes que se han considerado son los flujos contractuales sin descontar.

Dotación para Gastos Ordinarios

En la fecha de constitución del Fondo, el Cedente realizó una dotación al Compartimento en Dólares por importe de 4.300 euros para Gastos Ordinarios del Compartimento en Dólares y una dotación al Compartimento en Euros por importe de 4.300 euros para Gastos Ordinarios del Compartimento en Euros. Cada Dotación para Gastos ordinarios únicamente se utilizará para el pago, en cada Fecha de Pago durante el primer año del punto (i) del Orden de Prelación de Pagos del Compartimento correspondiente, en caso de que no hubiera otros Recursos Disponibles de dicho Compartimento para ello.

Las Dotaciones para Gastos Ordinarios serán devueltas al Cedente en la primera fecha entre la siguientes: la fecha en la que se cumpla el primer aniversario desde la Fecha de Constitución o, en la fecha de liquidación anticipada del Fondo.

Riesgo de concentración

La exposición al riesgo surge por la concentración geográfica respecto de los deudores de los activos titulizados cedidos al Fondo, a cuyo nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sobre las diferentes áreas geográficas, pudiera afectar a los pagos de los activos titulizados que respaldan la emisión de los Pagarés de titulización del Fondo.

La distribución geográfica según la región o comunidad donde radican los activos titulizados a 31 de diciembre de 2023 se presenta en el Estado S.05.1 del Anexo I de la memoria.

**EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN**

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

Riesgo de crédito

El riesgo de crédito nace de la posible pérdida causada por el impago del conjunto de Activos Titulizados de la cartera titulizada del Fondo.

El siguiente cuadro muestra la exposición total al riesgo de crédito del Compartimento en euros a 31 de diciembre de 2023 y 2022:

	Miles de euros	
	31.12.2023	31.12.2022
Activos titulizados	524	6.148
Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	13	9
Total Riesgo	537	6.157

El siguiente cuadro muestra la exposición total al riesgo de crédito del Compartimento en Dólares a 31 de diciembre de 2023 y 2022:

	Miles de euros	
	31.12.2023	31.12.2022
Activos titulizados	20.883	23.885
Otros activos financieros	-	1
Ajustes por periodificación	-	-
Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	43	12
Total Riesgo	20.926	23.898

Riesgo de insolvencia del Fondo

Ante un supuesto de imposibilidad del Fondo de atender el pago de sus obligaciones de forma generaliza será de aplicación lo dispuesto en el artículo 23 de la Ley 5/2015, es decir, la Sociedad Gestora, tras informar a la CNMV, procederá a la liquidación ordenada del Fondo, conforme a las reglas establecidas al respecto en la Escritura de Constitución del Fondo.

El Fondo solo responderá del cumplimiento de sus obligaciones hasta el importe de sus activos.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

Riesgo de personalidad jurídica del Fondo

De acuerdo con el artículo 15 de la Ley 5/2015, el Fondo carece de personalidad jurídica. La Sociedad Gestora, en consecuencia, deberá de llevar a cabo su administración y representación y cumplir las obligaciones legalmente previstas con relación al Fondo y de cuyo incumplimiento será responsable frente a los Titulares de los Pagarés y el resto de los acreedores ordinarios del Fondo con el límite de su patrimonio.

Triggers del Fondo

El Fondo, y ambos Compartimentos, se liquidarán por las causas previstas en el artículo 23 de la Ley 5/2015, y en particular, de acuerdo con lo previsto en dicho artículo, por los siguientes Supuestos:

- (i) cuando se hayan amortizado los Pagarés de ambos Compartimentos y no se fuera a realizar una emisión de Pagarés adicional de ninguno de los dos Compartimentos en un plazo de doce (12) meses, previa confirmación por escrito del Cedente y de los Titulares de los Pagarés;
- (ii) cuando el Fondo no tenga Derecho de Crédito Cedido alguno en ninguno de los Compartimentos en su haber y no se prevea, previa confirmación por escrito del Cedente, que fuera a adquirir Derechos de Crédito Adicionales de ninguno de los Compartimentos en un plazo de dos (2) meses;
- (iii) en el supuesto de que la Sociedad Gestora fuera declarada en concurso y habiendo transcurrido el plazo de cuatro (4) meses, sin haber sido designada una nueva sociedad gestora, de acuerdo con lo establecido en la Estipulación 11.2 de la Escritura
- (iv) cuando, a juicio de la Sociedad Gestora, por razón de algún evento o circunstancia de cualquier índole ajena o no al desenvolvimiento propio del Fondo, incluidos los supuestos de modificación de la normativa fiscal vigente, se produjera una alteración sustancial o se desvirtuase de forma permanente el equilibrio financiero del Fondo. En este caso, la Sociedad Gestora, tras informar a la CNMV y a los Titulares de los Pagarés, procederá a la liquidación ordenada del Fondo conforme a las reglas establecidas en la Escritura;
- (v) en la Fecha de Vencimiento Final (inicial o la posteriormente determinada por acuerdo entre la Sociedad Gestora, el Cedente y los Titulares de los Pagarés);
- (vi) en el caso de que no fuera posible la sustitución del Administrador de Facturas cuando (i) exista una previsión razonable de que el proceso de sustitución puede extenderse más de dos (2) meses, o (ii) en el caso de que, una vez iniciado el proceso, éste se extienda en más de cuatro (4) meses sin que haya sido posible culminarlo;
- (vii) en el caso de que la presente Escritura no fuera inscrita en el registro de CNMV en el plazo de (1) mes desde la fecha de su otorgamiento;
- (viii) cuando se produzca un impago indicativo de un desequilibrio grave y permanente en relación con los Pagarés o se prevea que se vaya a producir;

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

(ix) en el supuesto de que la Sociedad Gestora cuente con el consentimiento y la aceptación expresa de todos los Titulares de los Pagarés de ambos Compartimentos y del Cedente, tanto en relación con el pago de las cantidades correspondientes a la liquidación anticipada, así como en relación con el procedimiento de liquidación.

(5) Activos financieros

Este epígrafe recoge principalmente los Activos Titulizados que ZEPa FINANCE, S.L., ha cedido al Fondo. Dichos Activos Titulizados derivan de facturas emitidas por distintos clientes a sus respectivos deudores y cedidas previamente a ZEPa FINANCE, S.L. por la existencia de Contratos de Cesión firmados por ZEPa FINANCE, S.L. con sus respectivos Proveedores. La actividad de ZEPa FINANCE, S.L. se limita a una labor de intermediación, adquiriendo derechos de cobro derivados de facturas, pagarés a la orden y pagarés no a la orden, denominados tanto en dólares americanos como en euros de sus Proveedores, pertenecientes a cualquier tipo de actividad o sector, con la finalidad de cederlos a terceros.

La composición de la cartera de activos financieros del Compartimento en euros al 31 de diciembre de 2023 y 2022 es la siguiente:

	Miles de euros					
	2023			2022		
	Corriente	No corriente	Total	Corriente	No corriente	Total
Activos Titulizados						
Cuentas a cobrar	523	-	523	6.145	-	6.145
Intereses y gastos devengados no vencidos	1	-	1	3	-	3
Saldo final cierre del ejercicio	524	-	524	6.148	-	6.148

La composición de la cartera de activos financieros del Compartimento en Dólares a 31 de diciembre de 2023 y 2022, es la siguiente:

	Miles de euros					
	2023			2022		
	Corriente	No corriente	Total	Corriente	No corriente	Total
Activos Titulizados						
Cuentas a cobrar	20.618	-	20.618	23.855	-	23.855
Intereses y gastos devengados no vencidos	265	-	265	30	-	30
Otros activos financieros	-	-	-			
Deudores y otras cuentas a cobrar	-	-	-	1	-	1
Saldo final cierre del ejercicio	20.883	-	20.883	23.886	-	23.886

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

El movimiento de los Activos Titulizados del ejercicio 2023 y 2022 del Compartimento en **Euros** es el siguiente:

	Miles de euros	
	31.12.2023	31.12.2022
Saldo Inicial	6.145	-
Adquisición de Activos Titulizados	18.739	98.994
Amortización ordinaria	(24.361)	(92.849)
Amortización anticipada	-	-
Amortizaciones previamente impagadas	-	-
Activos titulizados dados de baja por adjudicación/dación de bienes	-	-
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	-	-
Recompra	-	-
	523	6.145

El Fondo adquirió un total de 18.739 miles de euros de Activos Titulizados procedentes del Cedente que se detallan en las siguientes fechas de compra.

	Miles de euros
31/03/2023	486
30/06/2023	85
31/07/2023	1.077
30/09/2023	11.168
31/10/2023	5.400
31/12/2023	523

Al 31 de diciembre de 2023 y 2022 no se han registrado saldos en activos dudosos ni en correcciones de valor.

Al 31 de diciembre de 2023 y 2022 no se ha registrado ningún importe por saldos fallidos.

Durante el ejercicio 2023 se han devengado intereses implícitos por los Activos Titulizados por importe de 100 miles de euros (514 miles de euros en el ejercicio 2022), habiendo quedado importes devengados pendientes de vencimiento a cierre del ejercicio 2023 por importe de 1 miles de euros (3 miles de euros en el ejercicio 2022).

**EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN**

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

**El movimiento de los Activos Titulizados del ejercicio 2023 y 2022 del Compartimento en
Dólares es el siguiente:**

	Miles de euros	
	31.12.2023	31.12.2022
Saldo Inicial	23.855	2.788
Adquisición de Activos Titulizados	72.423	219.739
Amortización ordinaria	(75.603)	(206.523)
Amortización anticipada	-	-
Amortizaciones previamente impagadas	-	-
Activos titulizados dados de baja por adjudicación/dación de bienes	-	-
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	-	-
Recompra	-	-
Diferencia de cambio	(57)	7.851
Saldo final cierre del periodo	20.618	23.855

El Fondo adquirió un total de 72.423 miles de euros de Activos Titulizados procedentes del Cedente que se detallan en las siguientes fechas de compra.

	Miles de dólares(*)
31/03/2023	3.022
30/04/2023	4.566
30/06/2023	11.631
31/07/2023	11.469
30/09/2023	21.732
31/10/2023	3.515
30/11/2023	12.053
31/12/2023	10.730

(*) Los importes de esta tabla se muestran en dólares. Se ha aplicado el tipo de cambio oficial del BCE en cada fecha de compra para obtener los 72.423 miles de euros.

Al 31 de diciembre de 2023 y 2022 no se han registrado saldos en activos dudosos ni en correcciones de valor.

Al 31 de diciembre de 2023 y 2022 no se ha registrado ningún importe por saldos fallidos.

**EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN**

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

Durante el ejercicio 2023 y 2022 se han devengado intereses implícitos por los Activos Titulizados por importe de 491 y 1.202 miles de euros, respectivamente, habiendo quedado importes devengados pendientes de vencimiento a cierre del ejercicio 2023 y 2022 por importe de 265 y 30 miles de euros.

Al 31 de diciembre de 2023 el tipo de interés medio de los activos titulizados del Compartimento en euros era del 3,00% (2022: 3,00%), con un tipo de interés nominal máximo del 4,25% (2022: 3,00%) y mínimo del 3,00% (2022: 3,00%).

Las características principales de la cartera del Compartimento en euros al 31 de diciembre de 2023 y al 31 de diciembre de 2022 son las siguientes:

	31.12.2023	31.12.2022
Tasa de amortización anticipada	0,00%	0,00%
Tasa de fallido	0,00%	0,00%
Tasa de recuperación fallidos	0,00%	0,00%
Tasa de activos dudosos	0,00%	0,00%

Al 31 de diciembre de 2023 el tipo de interés medio de los activos titulizados del Compartimento en dólares era del 3,09% (2022: 3,00%), con un tipo de interés nominal máximo del 3,50% (2022: 3,00%) y mínimo del 3,00% (2022: 3,00%).

Las características principales de la cartera del Compartimento en dólares al 31 de diciembre de 2023 y al 31 de diciembre de 2022 son las siguientes:

	31.12.2023	31.12.2022
Tasa de amortización	0,00%	0,00%
Tasa de fallido	0,00%	0,00%
Tasa de recuperación fallidos	0,00%	0,00%
Tasa de activos dudosos	0,00%	0,00%

**EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN**

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

El desglose por vencimientos de los “Activos titulizados” del compartimento en euros, al 31 de diciembre de 2023 y 2022, sin considerar, en su caso, las correcciones de valor por deterioro de activos, los intereses vencidos e impagados y los intereses devengados (incluidos los de activos dudosos) se muestra a continuación:

	Miles de euros					
	2024	2025	2026	2027	2028	Resto
Activos titulizados	523	-	-	-	-	-
Total	523	-	-	-	-	-

	Miles de euros					
	2023	2024	2025	2026	2027	Resto
Activos titulizados	6.145	-	-	-	-	-
Total	6.145	-	-	-	-	-

El desglose por vencimientos de los “Activos titulizados” del compartimento en dólares, al 31 de diciembre de 2023 y 31 de diciembre de 2022, sin considerar, en su caso, las correcciones de valor por deterioro de activos, los intereses vencidos e impagados y los intereses devengados (incluidos los de activos dudosos) se muestra a continuación:

	Miles de euros					
	2024	2025	2026	2027	2028	Resto
Activos titulizados	20.618	-	-	-	-	-
Total	20.618	-	-	-	-	-

	Miles de euros					
	2023	2024	2025	2026	2027	Resto
Activos titulizados	23.855	-	-	-	-	-
Total	23.855	-	-	-	-	-

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

(6) Efectivo y otros activos líquidos equivalentes

El detalle de este epígrafe al 31 de diciembre de 2023 y al 31 de diciembre de 2022 es el siguiente:

	Miles de euros	
	31.12.2023	31.12.2022
Tesorería (euros)	13	9
Tesorería (dólares)	43	12

Al 31 de diciembre de 2023 y 2022 este epígrafe se compone del saldo depositado en las cuentas abiertas en EBN Banco de Negocios, S.A. (Cuenta de Tesorería, Cuenta de Cobros, Cuenta de Compras y Cuenta de Reservas).

Las cantidades depositadas en la Cuenta de Tesorería, Cuenta de Cobros, Compras y Reservas no devengarán interés alguno a favor del Fondo.

(7) Pasivos financieros

La composición de los pasivos financieros del Compartimento en euros al 31 de diciembre de 2023 y 2022 es la siguiente:

	Miles de euros					
	2023			2022		
	Corriente	No corriente	Total	Corriente	No corriente	Total
Obligaciones y otros valores emitidos						
Series no subordinadas	523	-	523	6.145	-	6.145
Intereses y gastos devengados no vencidos	-	-	-	1	-	1
	523	-	523	6.146	-	6.146
Deudas con entidades de crédito						
Préstamo Subordinado	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
Otros pasivos financieros						
Acreedores y otras cuentas a pagar	8	-	8	4	-	4
	8	-	8	4	-	4
Saldo final cierre del ejercicio	531	-	531	6.150	-	6.150

**EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN**

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

La composición de los pasivos financieros del Compartimento en dólares al 31 de diciembre de 2023 y 2022, es la siguiente:

	Miles de euros					
	2023			2022		
	Corriente	No corriente	Total	Corriente	No corriente	Total
Obligaciones y otros valores emitidos						
Series no subordinadas	20.618	-	20.618	23.855	-	23.855
Intereses y gastos devengados no vencidos	28	-	28	15	-	15
	20.646	-	20.646	23.870	-	23.870
Deudas con entidades de crédito						
Préstamo Subordinado	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
Otros pasivos financieros						
Acreedores y otras cuentas a pagar	179	-	179	-	-	-
	179	-	179	-	-	-
Saldo final cierre del ejercicio	20.825	-	20.825	23.870	-	23.870

El movimiento de los Pagarés titulizados del Compartimento en euros durante el ejercicio 2023 y 2022 ha sido el siguiente:

	Miles de euros	
	2023	2022
Saldo inicial	6.145	-
Nuevas emisiones	18.739	98.994
Amortizaciones	(24.361)	(92.849)
Saldo final	523	6.145

Durante el ejercicio 2023 y 2022, se han devengado intereses y cargas asimiladas por un importe de 52 y 259 miles de euros, respectivamente, registrados en "Obligaciones y otros valores emitidos" de la cuenta de pérdidas y ganancias adjunta, no encontrándose pendiente de vencimiento ningún importe (a 31 de diciembre de 2022 había registrado 1 miles de euros) en "Intereses y gastos devengados no vencidos" en el epígrafe de "Obligaciones y otros valores emitidos" del pasivo corriente.

**EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN**

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

El movimiento de los Pagarés titulizados del Compartimento en dólares durante el ejercicio 2023 y 2022 ha sido el siguiente:

	Miles de euros	
	2023	2022
Saldo inicial	23.855	2.788
Nuevas emisiones	72.638	219.740
Amortizaciones	(74.470)	(206.524)
Diferencia de Cambio	(1.405)	7.851
Saldo final	20.618	23.855

Durante el ejercicio 2023 y 2022, se han devengado intereses y cargas asimiladas por un importe de 274 y 604 miles de euros, respectivamente, registrados en “Obligaciones y otros valores emitidos” de la cuenta de pérdidas y ganancias adjunta, encontrándose pendientes de vencimiento 28 y 15 miles de euros, respectivamente, registrados en “Intereses y gastos devengados no vencidos” en el epígrafe de “Obligaciones y otros valores emitidos” del pasivo corriente.

Durante el ejercicio 2023 se han emitido 18.739 miles de euros en Pagarés por el Compartimento en euros:

Nº Pagarés	Nominal unitario	Fecha emisión	Tipo de Interés de los Pagarés	Fecha vencimiento
1	419	31/03/2023	3,50%	10/05/2023
1	67	31/03/2023	3,50%	10/05/2023
1	85	02/06/2023	3,50%	16/08/2023
1	1.078	04/07/2023	3,00%	11/10/2023
1	9.803	05/09/2023	3,50%	18/10/2023
1	489	26/09/2023	3,00%	15/11/2023
1	340	29/09/2023	3,00%	15/11/2023
1	536	29/09/2023	3,00%	15/11/2023
1	4.902	03/10/2023	3,00%	22/11/2023
1	498	06/10/2023	3,00%	22/11/2023
1	12	12/12/2023	3,00%	18/01/2024
1	199	12/12/2023	3,00%	21/03/2024
1	145	15/12/2023	3,00%	22/03/2024
1	166	22/12/2023	3,00%	22/03/2024

**EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN**

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

Durante el ejercicio 2022 se han emitido los siguientes Pagarés es el Compartimento en euros:

Nº Pagarés	Nominal unitario	Fecha emisión	Tipo de Interés de los Pagarés	Fecha vencimiento
1	300	22/03/2022	3,00%	08/04/2022
1	164	11/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	193	11/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	812	15/03/2022	3,00%	15/04/2022
1	44	18/03/2022	3,00%	13/04/2022
1	433	18/03/2022	3,00%	13/04/2022
1	439	22/03/2022	3,00%	12/04/2022
1	147	22/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	911	22/03/2022	3,00%	13/04/2022
1	265	22/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	281	25/03/2022	3,00%	12/04/2022
1	247	25/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	2.237	25/03/2022	3,00%	14/04/2022
1	34	29/03/2022	3,00%	12/04/2022
1	38	29/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	216	29/03/2022	3,00%	15/04/2022
1	247	01/04/2022	3,00%	13/04/2022
1	331	05/04/2022	3,00%	13/04/2022
1	102	05/04/2022	3,00%	11/04/2022
1	408	29/03/2022	3,00%	27/04/2022
1	137	05/04/2022	3,00%	27/04/2022
1	208	01/04/2022	3,00%	04/05/2022
1	819	08/04/2022	3,00%	04/05/2022
1	114	04/02/2022	3,50%	26/05/2022
1	245	18/03/2022	3,00%	12/07/2022
1	1.830	18/03/2022	3,00%	12/07/2022
1	265	18/03/2022	3,00%	11/07/2022
1	592	18/03/2022	3,00%	12/07/2022
1	119	22/03/2022	3,00%	12/07/2022
1	188	25/03/2022	3,00%	12/07/2022
1	91	25/03/2022	3,00%	15/07/2022
1	728	25/03/2022	3,00%	12/07/2022
1	1.559	29/03/2022	3,00%	12/07/2022
1	1.963	29/03/2022	3,00%	15/07/2022
1	36	01/04/2022	3,00%	08/07/2022
1	297	01/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	289	01/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	1.074	01/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	214	05/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	594	05/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	284	08/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	754	19/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	205	22/04/2022	3,00%	08/07/2022
1	366	26/04/2022	3,00%	11/07/2022
1	945	26/04/2022	3,00%	10/08/2022
1	1.283	29/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	1.226	29/04/2022	3,00%	13/07/2022
1	1.878	29/04/2022	3,00%	14/07/2022

**EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN**

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

1	919	10/05/2022	3,00%	10/08/2022
1	16.565	13/05/2022	3,00%	19/07/2022
1	8.279	13/05/2022	3,00%	26/07/2022
1	12.502	13/05/2022	3,00%	10/08/2022
1	2.373	13/05/2022	3,00%	27/07/2022
1	717	13/05/2022	3,00%	14/07/2022
1	1.931	20/05/2022	3,00%	11/07/2022
1	1.315	24/06/2022	3,00%	14/07/2022
1	19.215	05/07/2022	3,00%	27/07/2022
1	1.521	23/09/2022	3,00%	20/10/2022
1	997	26/08/2022	3,00%	14/11/2022
1	623	07/10/2022	3,00%	19/12/2022
1	1.043	07/12/2022	3,00%	27/03/2023
1	381	09/12/2022	3,00%	18/01/2023
1	4.732	30/12/2022	3,00%	31/01/2023

Durante el ejercicio 2023 se han emitido los siguientes Pagarés por el Compartimento en dólares:

Nº Pagarés	Nominal unitario USD	Fecha emisión	Tipo de Interés de los Pagarés	Fecha vencimiento
1	697	31/03/2023	3,50%	10/05/2023
1	728	31/03/2023	3,50%	19/04/2023
1	900	31/03/2023	3,50%	10/05/2023
1	589	31/03/2023	3,50%	10/05/2023
1	109	31/03/2023	3,50%	10/05/2023
1	287	04/04/2023	3,50%	10/05/2023
1	982	11/04/2023	3,50%	10/05/2023
1	838	11/04/2023	3,50%	19/04/2023
1	200	11/04/2023	3,50%	10/05/2023
1	2.259	11/04/2023	3,50%	10/05/2023
1	872	23/06/2023	3,50%	16/10/2023
1	10.759	23/06/2023	3,50%	08/11/2023
1	216	10/07/2023	3,50%	16/10/2023
1	4.139	04/07/2023	3,50%	18/10/2023
1	108	04/07/2023	3,50%	25/10/2023
1	984	04/07/2023	3,50%	11/10/2023
1	2.091	04/07/2023	3,50%	18/10/2023
1	3.200	04/07/2023	3,50%	25/10/2023
1	731	07/07/2023	3,50%	08/11/2023
1	1.165	05/09/2023	3,50%	18/10/2023
1	2.949	12/09/2023	3,50%	18/10/2023
1	10.317	15/09/2023	3,50%	18/10/2023

**EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN**

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

1	5.141	29/09/2023	3,50%	15/11/2023
1	2.159	29/09/2023	3,50%	20/11/2023
1	3.217	02/10/2023	3,50%	15/11/2023
1	196	02/10/2023	3,50%	15/11/2023
1	102	03/10/2023	3,50%	15/11/2023
1	1.323	17/11/2023	3,50%	18/01/2024
1	972	24/11/2023	3,50%	18/01/2024
1	795	28/11/2023	3,50%	18/01/2024
1	2.380	30/11/2023	3,50%	22/02/2024
1	4.308	30/11/2023	3,50%	18/01/2024
1	2.275	30/11/2023	3,50%	21/02/2024
1	3.099	01/12/2023	3,50%	21/03/2024
1	2.040	12/12/2023	3,50%	21/03/2024
1	1.074	15/12/2023	3,50%	14/03/2024
1	1.494	29/12/2023	3,50%	12/02/2024
1	1.094	29/12/2023	3,50%	14/03/2024
1	1.930	29/12/2023	3,50%	14/03/2024

Durante el ejercicio 2022 se han emitido los siguientes Pagarés por el Compartimento en dólares:

Nº Pagarés	Nominal unitario USD	Fecha emisión	Tipo de Interés de los Pagarés	Fecha vencimiento
1	6.831	04/03/2022	3,00%	06/04/2022
1	291	18/03/2022	3,00%	06/04/2022
1	727	04/03/2022	3,00%	07/04/2022
1	283	11/03/2022	3,00%	07/04/2022
1	88	11/03/2022	3,00%	07/04/2022
1	108	15/03/2022	3,00%	07/04/2022
1	337	15/03/2022	3,00%	06/04/2022
1	133	18/03/2022	3,00%	07/04/2022
1	201	29/03/2022	3,00%	07/04/2022
1	138	29/03/2022	3,00%	07/04/2022
1	345	01/04/2022	3,00%	07/04/2022
1	1.372	04/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	715	04/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	233	08/03/2022	3,00%	08/04/2022
1	2.117	11/03/2022	3,00%	13/04/2022
1	143	11/03/2022	3,00%	13/04/2022
1	1.694	11/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	374	11/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	1.165	11/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	1.753	11/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	1.337	11/03/2022	3,00%	08/04/2022
1	641	18/03/2022	3,00%	08/04/2022
1	256	18/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	1.967	18/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	1.031	22/03/2022	3,00%	08/04/2022

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

1	302	22/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	1.023	22/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	1.346	25/03/2022	3,00%	12/04/2022
1	2.078	25/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	846	25/03/2022	3,00%	14/04/2022
1	1.185	25/03/2022	3,00%	08/04/2022
1	2.323	25/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	1.065	25/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	170	25/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	815	25/03/2022	3,00%	08/04/2022
1	222	29/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	2.566	29/03/2022	3,00%	11/04/2022
1	2.231	01/04/2022	3,00%	11/04/2022
1	652	01/04/2022	3,00%	11/04/2022
1	1.246	01/04/2022	3,00%	13/04/2022
1	265	01/04/2022	3,00%	11/04/2022
1	3.064	01/04/2022	3,00%	08/04/2022
1	94	05/04/2022	3,00%	13/04/2022
1	2.607	05/04/2022	3,00%	14/04/2022
1	4.542	08/04/2022	3,00%	11/04/2022
1	500	25/03/2022	3,00%	30/04/2022
1	714	01/04/2022	3,00%	27/04/2022
1	381	08/04/2022	3,00%	27/04/2022
1	621	12/04/2022	3,00%	27/04/2022
1	166	01/04/2022	3,00%	04/05/2022
1	384	05/04/2022	3,00%	04/05/2022
1	551	12/04/2022	3,00%	04/05/2022
1	565	25/01/2022	3,50%	17/05/2022
1	792	25/01/2022	3,00%	17/05/2022
1	308	01/02/2022	3,50%	20/05/2022
1	684	01/02/2022	3,50%	20/05/2022
1	61	19/04/2022	3,00%	11/05/2022
1	653	26/04/2022	3,00%	11/05/2022
1	153	03/05/2022	3,00%	17/05/2022
1	488	18/02/2022	3,50%	10/06/2022
1	662	18/02/2022	3,50%	14/06/2022
1	245	18/03/2022	3,00%	12/07/2022
1	132	18/03/2022	3,00%	07/07/2022
1	601	18/03/2022	3,00%	12/07/2022
1	11.946	18/03/2022	3,00%	15/07/2022
1	202	18/03/2022	3,00%	12/07/2022
1	3.950	22/03/2022	3,00%	11/07/2022
1	756	22/03/2022	3,00%	17/08/2022
1	3.219	25/03/2022	3,00%	12/07/2022
1	2.022	25/03/2022	3,00%	11/07/2022
1	2.236	25/03/2022	3,00%	12/07/2022
1	8.960	29/03/2022	3,00%	17/08/2022
1	146	29/03/2022	3,00%	17/08/2022
1	6.754	29/03/2022	3,00%	03/08/2022
1	3.977	29/03/2022	3,00%	15/07/2022
1	646	29/03/2022	3,00%	07/07/2022
1	539	29/03/2022	3,00%	12/07/2022
1	3.342	29/03/2022	3,00%	15/07/2022
1	911	01/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	393	01/04/2022	3,00%	12/07/2022

**EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN**

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

1	262	01/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	3.219	01/04/2022	3,00%	03/08/2022
1	8.698	01/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	4.391	01/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	924	01/04/2022	3,00%	15/07/2022
1	2.825	01/04/2022	3,00%	15/07/2022
1	338	05/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	1.026	05/04/2022	3,00%	17/08/2022
1	1.357	05/04/2022	3,00%	22/07/2022
1	2.069	05/04/2022	3,00%	15/07/2022
1	139	05/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	1.318	05/04/2022	3,00%	10/08/2022
1	624	08/04/2022	3,00%	10/08/2022
1	8.316	08/04/2022	3,00%	13/07/2022
1	399	08/04/2022	3,00%	15/07/2022
1	192	12/04/2022	3,00%	03/08/2022
1	137	12/04/2022	3,00%	15/07/2022
1	129	12/04/2022	3,00%	07/07/2022
1	182	12/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	2.049	19/04/2022	3,00%	15/07/2022
1	311	19/04/2022	3,00%	17/08/2022
1	1.428	19/04/2022	3,00%	11/07/2022
1	173	22/04/2022	3,00%	03/08/2022
1	66	22/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	2.026	22/04/2022	3,00%	11/07/2022
1	140	22/04/2022	3,00%	03/08/2022
1	1.512	22/04/2022	3,00%	13/07/2022
1	6.087	26/04/2022	3,00%	11/07/2022
1	963	26/04/2022	3,00%	11/07/2022
1	680	26/04/2022	3,00%	12/07/2022
1	584	29/04/2022	3,00%	13/07/2022
1	188	29/04/2022	3,00%	14/07/2022
1	145	29/04/2022	3,00%	17/08/2022
1	194	06/05/2022	3,00%	17/08/2022
1	1.207	10/05/2022	3,00%	12/07/2022
1	2.154	13/05/2022	3,00%	12/07/2022
1	1.228	17/05/2022	3,00%	10/08/2022
1	136	20/05/2022	3,00%	08/07/2022
1	217	24/05/2022	3,00%	07/07/2022
1	6.988	17/06/2022	3,00%	28/07/2022
1	8.197	17/06/2022	3,00%	28/07/2022
1	1.370	21/06/2022	3,00%	03/08/2022
1	2.616	24/06/2022	3,00%	18/07/2022
1	1.206	24/06/2022	3,00%	27/07/2022
1	2.013	28/06/2022	3,00%	27/07/2022
1	1.002	05/07/2022	3,00%	27/07/2022
1	998	17/06/2022	3,00%	07/10/2022
1	1.057	16/09/2022	3,00%	24/10/2022
1	1.574	23/09/2022	3,00%	20/10/2022
1	4.268	30/09/2022	3,00%	19/10/2022
1	3.816	30/09/2022	3,00%	26/10/2022
1	3.991	23/09/2022	3,00%	21/11/2022
1	836	23/09/2022	3,00%	21/11/2022
1	2.981	02/12/2022	3,00%	18/01/2023
1	811	13/12/2022	3,00%	18/01/2023

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

1	1.267	16/12/2022	3,00%	18/01/2023
1	7.496	16/12/2022	3,00%	22/02/2023
1	4.676	16/12/2022	3,00%	23/03/2023
1	623	16/12/2022	3,00%	18/01/2023
1	3.409	16/12/2022	3,00%	18/01/2023
1	1.336	16/12/2022	3,00%	18/01/2023
1	57	23/12/2022	3,00%	18/01/2023
1	524	28/12/2022	3,00%	18/01/2023
1	2.322	30/12/2022	3,00%	31/01/2023

Al 31 de diciembre de 2023 y 2022 no había saldos registrados en el epígrafe de Deudas con Entidades de Crédito del Compartimento en euros.

Al 31 de diciembre de 2023 y 2022 no había saldos registrados en el epígrafe de Deudas con Entidades de Crédito del Compartimento en dólares.

(8) Liquidaciones intermedias

El detalle de las liquidaciones de cobros y pagos producidas durante el ejercicio de 2023 y 2022 del compartimento en euros es el siguiente:

<i>Liquidación de cobros y pagos del periodo</i>	Miles de euros	
	2023	2022
<u>Activos titulizados clasificados en el Activo</u>		
Pagos por adquisición de activos financieros	(18.739)	(98.994)
Cobros por amortizaciones ordinarias	24.361	92.849
Cobros por amortizaciones anticipadas	-	-
Cobros por intereses ordinarios	102	511
Cobros por intereses previamente impagados	-	-
Cobros por amortizaciones previamente impagadas	-	-
Otros cobros en especie	-	-
Otros cobros en efectivo	-	-
<u>Series emitidas clasificadas en el Pasivo</u>		
Cobros por la emisión de valores de titulización	18.739	98.994
Pagos por amortización ordinaria	(24.361)	(92.849)
Pagos por intereses ordinarios	(42)	(209)
Pagos por amortización de préstamos subordinados	-	-
Pagos por intereses de préstamos subordinados	-	-
Otros pagos del período	(47)	(262)

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

El detalle de las liquidaciones de cobros y pagos producidas durante el ejercicio de 2023 y 2022 del compartimento en dólares es el siguiente:

<i>Liquidación de cobros y pagos del período</i>	Miles de euros	
	2023	2022
<u>Activos titulizados clasificados en el Activo</u>		
Pagos por adquisición de activos financieros	(72.423)	(219.737)
Cobros por amortizaciones ordinarias	75.603	206.523
Cobros por amortizaciones anticipadas	-	-
Cobros por intereses ordinarios	471	1.215
Cobros por intereses previamente impagados	-	-
Cobros por amortizaciones previamente impagadas	-	-
Otros cobros en especie	-	-
Otros cobros en efectivo	-	-
<u>Series emitidas clasificadas en el Pasivo</u>		
Cobros por la emisión de valores de titulización	72.638	219.740
Pagos por amortización ordinaria	(74.470)	(206.516)
Pagos por intereses ordinarios	(208)	(495)
Pagos por amortización de préstamos subordinados	-	-
Pagos por intereses de préstamos subordinados	-	-
Otros pagos del período	(1.373)	(598)

**EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN**

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

Durante el ejercicio 2023 y 2022 el movimiento de las partidas por el margen de intermediación del compartimento en euros entre la cuenta de pérdidas y ganancias, el balance y el estado de flujos de efectivo ha sido el siguiente:

	Miles de euros		
	31.12.2023		
	Provisión por margen de intermediación	Comisión variable	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas
Saldo a 31 de diciembre de 2021	-	5	-
Comisión variable (cuenta de pérdidas y ganancias)	-	64	-
Dotación/(Reversión) provisión margen intermediación	-	-	-
Repercusión de (pérdidas) ganancias	-	(68)	-
Comisión variable pagada en el ejercicio	-	-	-
Otros	-	(1)	-
Saldo a 31 de diciembre de 2022	-	-	-
Comisión variable (cuenta de pérdidas y ganancias)	-	-	-
Dotación/(Reversión) provisión margen intermediación	-	-	-
Repercusión de (pérdidas) ganancias	-	-	-
Comisión variable pagada en el ejercicio	-	-	-
Otros	-	-	-
Saldo a 31 de diciembre de 2023	-	-	-

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

Durante el ejercicio 2023 y 2022 el movimiento de las partidas por el margen de intermediación del compartimento en dólares entre la cuenta de pérdidas y ganancias, el balance y el estado de flujos de efectivo ha sido el siguiente:

	Miles de euros		
	31.12.2023		
	Provisión por margen de intermediación	Comisión variable	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas
Saldo a 31 de diciembre de 2021	-	7	-
Comisión variable (cuenta de pérdidas y ganancias)	-	128	-
Dotación/(Reversión) provisión margen intermediación	-	-	-
Repercusión de (pérdidas) ganancias	-	(121)	-
Comisión variable pagada en el ejercicio	-	-	-
Otros	-	-	-
Saldo a 31 de diciembre de 2022	-	14	-
Comisión variable (cuenta de pérdidas y ganancias)	-	-	-
Dotación/(Reversión) provisión margen intermediación	-	-	-
Repercusión de (pérdidas) ganancias	-	(14)	-
Comisión variable pagada en el ejercicio	-	-	-
Otros	-	-	-
Saldo a 31 de diciembre de 2023	-	-	-

(9) Situación fiscal

El resultado económico del ejercicio 2023 y 2022 es cero y coincide con la base imponible del Impuesto sobre Sociedades, todo ello de acuerdo con el propio funcionamiento del Fondo que debe carecer de valor patrimonial.

Según las disposiciones legales vigentes las liquidaciones de impuestos no pueden considerarse definitivas hasta que no hayan sido inspeccionadas por las autoridades fiscales o haya transcurrido el plazo de prescripción de cuatro años.

De conformidad con la Ley 2/2010, de 1 de marzo, en tanto no se establezcan reglamentariamente las normas relativas a la deducibilidad de las correcciones valorativas por deterioro de valor de los instrumentos de deuda valorados por su coste amortizado que posean los fondos de titulización hipotecaria y los fondos de titulización de activos, son de aplicación a éstos los criterios establecidos para las entidades de crédito sobre la deducibilidad de la cobertura específica del riesgo de insolvencia de los clientes.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Memoria de Cuentas Anuales

31 de diciembre de 2023

(10) Otra información

El auditor de cuentas de la Sociedad es KPMG Auditores, S.L. Los honorarios de auditoría correspondientes a los ejercicios 2023 y 2022 han ascendido a 7 miles de euros en ambos periodos, con independencia del momento de su facturación.

Los instrumentos financieros han sido valorados al 31 de diciembre de 2023 y 2022, en base a los criterios recogidos en la nota 3 de estas Cuentas Anuales, los cuales no difieren de forma significativa del valor razonable de dichos instrumentos.

Al 31 de diciembre de 2023 y 2022 el Fondo no tenía ningún importe significativo pendiente de pago a sus proveedores en operaciones comerciales que a dicha fecha acumulara un plazo superior al plazo legal de pago.

Con fecha 23 de febrero de 2022 la Sociedad Gestora, en nombre y representación del Fondo, modificó la Escritura de Constitución y la Escritura Complementaria a los efectos de incrementar el Importe Máximo del Programa, fijado en 100.000.000 euros y/o dólares, hasta 250.000.000 euros y/o dólares. Este hecho fue comunicado previamente a CNMV.

(11) Información sobre medio ambiente

Los Administradores de la Sociedad Gestora consideran mínimos, y en todo caso adecuadamente cubiertos los riesgos medioambientales que se pudieran derivar de la actividad del Fondo, y estiman que no surgirán pasivos adicionales relacionados con dichos riesgos. El Fondo no ha incurrido en gastos ni recibido subvenciones relacionadas con dichos riesgos, durante el ejercicio 2023 y 2022.

(12) Hechos posteriores

Desde el 31 de diciembre de 2023 y hasta la fecha de formulación de estas cuentas anuales por parte del Consejo de Administración de la Sociedad Gestora del Fondo, no ha ocurrido ningún acontecimiento significativo digno de mención.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,
FONDO DE TITULIZACIÓN

Informe de Gestión

Ejercicio 2023

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO Fondo de Titulización, fue constituido por EBN TITULIZACION S.A.U, S.G.F.T el 12 de enero de 2021, con carácter de fondo abierto por el activo y por el pasivo, dividido en dos compartimentos separados, uno destinado a la agrupación de los Derechos de Crédito en Dólares y el otro a la agrupación de los Derechos de Crédito en Euros. En la Fecha de Constitución del Fondo se constituyó el Compartimento en Euros.

El 12 de enero de 2021 el Fondo emitió un Pagaré en Euros, perteneciente al Compartimento en Euros, por un importe nominal total de 925.722,40 Euros. Posteriormente, el 29 de marzo de 2021, se constituyó el Compartimento en Dólares, con una primera emisión, la cual fue de un Pagaré cuyo importe nominal total ascendió a 1.764.880,65 Dólares.

El Pagaré Inicial fué suscrito por EBN Banco, S.A. A lo largo del ejercicio 2023, los pagarés han sido suscritos por otros inversores cualificados de conformidad con el artículo 22.4 de la Ley 5/2015, de 27 de abril, la circulación de los Bonos estará restringida a inversores cualificados .

Tras las emisiones de pagarés en Euros durante el ejercicio 2023, el saldo nominal pendiente de cobro a 31 diciembre de 2.023 es de 527.512,55 Euros. Asimismo, tras las emisiones de pagarés en Dólares durante el ejercicio 2023, el saldo nominal pendiente de cobro a 31 de diciembre de 2023 es de 22.947.921,27 Dólares.

El precio de compra de los activos cedidos del Compartimento en Euros durante 2023 ascendió a 18.739.269,06 Euros y el importe nominal del total de la cartera comprada fue de 18.822.475,29 Euros.

El precio de compra de los activos cedidos del Compartimento en Dólares durante 2023 ascendió a 78.719.167,76 Dólares y el importe nominal del total de la cartera comprada fue de 79.273.894,86 Dólares.

Al cierre de este ejercicio, quedaban por amortizar 4 Pagarés denominados en Euros por un importe nominal conjunto de 525.466,52 Euros y 12 Pagarés denominados en Dólares por un importe nominal conjunto de 22.877.337,79 Dólares.

Al 31 de diciembre de 2023, el saldo de las cuentas del Compartimento en Euros ascendía a 12.621 € Euros correspondiente al saldo depositado en la Cuenta de Tesorería. El resto de las cuentas del Fondo no tienen saldo a 31 de diciembre de 2023.

Al 31 de diciembre de 2023, el saldo de las cuentas del Compartimento en Dólares ascendía a 47.890 Dólares correspondientes al saldo depositado en las Cuentas de Tesorería. El resto de las cuentas del Fondo no tienen saldo a 31 de diciembre de 2023.

Las **“Fechas de Pago”** del Fondo son el último día hábil de los meses de febrero, mayo, agosto y noviembre de cada año.

Dotación para Gastos Ordinarios

En la fecha de constitución del Fondo, el Cedente realizó una dotación al Compartimento en Dólares por importe de 4.300 € para Gastos Ordinarios del Compartimento en Dólares y una dotación al Compartimento en Euros por importe de 4.300 € para Gastos Ordinarios del Compartimento en Euros. Cada Dotación para Gastos ordinarios únicamente se utilizará para el pago, en cada Fecha de Pago durante el primer año desde la constitución del Fondo, del punto (i) del Orden de Prelación de Pagos del Compartimento correspondiente, en caso de que no hubiera otros Recursos Disponibles de dicho Compartimento para ello.

Las Dotaciones para Gastos Ordinarios serán devueltas al Cedente en la primera fecha entre las siguientes: la fecha en la que se cumpla el primer aniversario desde la Fecha de Constitución o, en la fecha de liquidación anticipada del Fondo.

En la Fecha de Pago del Fondo del 31 de agosto de 2022, se procede a realizar la devolución al Cedente por los importes íntegros de ambos compartimentos.

Riesgos

Los riesgos son inherentes a la actividad del Fondo, pero los mismos son gestionados por la Sociedad Gestora a través de un proceso de identificación, medición y seguimiento continuo. No obstante, desde su constitución se estructura para que el impacto de los distintos riesgos en su estructura sea mínimo.

El Fondo está expuesto al riesgo de liquidez, al riesgo de concentración, al riesgo de crédito, al riesgo de insolvencia y al riesgo de falta de personalidad jurídica.

Riesgo de liquidez

Este riesgo refleja la posible dificultad del Fondo para disponer de fondos líquidos, o para poder acceder a ellos, en la cuantía suficiente y al coste adecuado, de forma que pueda hacer frente en todo momento a sus obligaciones de pago conforme al calendario de pago establecido en la Escritura del Fondo.

Riesgo de concentración

La exposición al riesgo surge por la concentración geográfica respecto de los deudores de los activos titulizados cedidos al Fondo, a cuyo nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sobre las diferentes áreas geográficas, pudiera afectar a los pagos de los activos titulizados que respaldan la emisión de los Pagarés de Titulización del Fondo.

Riesgo de crédito

El riesgo de crédito nace de la posible pérdida causada por el impago del conjunto de Activos Titulizados de la cartera titulizada del Fondo.

Riesgo de insolvencia del Fondo

Ante un supuesto de imposibilidad del Fondo de atender el pago de sus obligaciones de forma generalizadas será de aplicación lo dispuesto en el artículo 23 de la Ley 5/2015, es decir, la Sociedad Gestora, tras informar a la CNMV, procederá a la liquidación ordenada del Fondo, conforme a las reglas establecidas al respecto en la Escritura de Constitución del Fondo.

El Fondo solo responderá del cumplimiento de sus obligaciones hasta el importe de sus activos.

Riesgo de personalidad jurídica del Fondo

De acuerdo con el artículo 15 de la Ley 5/2015, el Fondo carece de personalidad jurídica. La Sociedad Gestora, en consecuencia, deberá de llevar a cabo su administración y representación y cumplir las obligaciones legalmente previstas con relación al Fondo y de cuyo incumplimiento será responsable frente a los Titulares de los Pagarés y el resto de los acreedores ordinarios del Fondo con el límite de su patrimonio.

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT

INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO
a 31 de diciembre de 2023

COMPARTIMENTO EN EUROS

CARTERA DEL ACTIVO

1. Información general

INFORMACIÓN REFERENTE A LOS DERECHOS DE CREDITO A 31/12/2023

Valor Nominal Pendiente de los Derechos de Crédito	527.513 €
Valor Nominal Medio de los Derechos de Crédito	105.503 €
Descuento Medio Anual de los Derechos de Crédito cedidos al Fondo	3,00%
Valor Contable de los Derechos de Crédito	523.421 €
Vencimiento Medio de los Derechos de Crédito (en días)	80
Vencimiento Máximo de los Derechos de Crédito (en días)	82
Vencimiento Mínimo de los Derechos de Crédito (en días)	18

2. Detalle de impagados

TOTAL IMPAGADOS

	Nº de Derechos de Crédito	Saldo Pendiente Vencido	Saldo Financiado Pendiente Vencido
Hasta 1 mes	0	0,00 €	0,00 €
De 1 a 3 meses	0	0,00 €	0,00 €
De 3 a 6 meses	0	0,00 €	0,00 €
De 6 a 9 meses	0	0,00 €	0,00 €
De 9 a 12 meses	0	0,00 €	0,00 €
Más de 12 meses	0	0,00 €	0,00 €
TOTAL	0	0,00 €	0,00 €

3. Detalle Vida Residual

VIDA RESIDUAL ACTIVOS TITULIZADOS	
Vida	Principal Pendiente
Inferior a 1 año	527.513 €
Entre 1 y 2 años	0,00 €
Entre 2 y 3 años	0,00 €
Entre 3 y 4 años	0,00 €
Entre 4 y 5 años	0,00 €
Entre 5 y 6 años	0,00 €
Superior a 10 años	0,00 €
TOTAL	527.513 €
Vida residual media ponderada (años)	0,22
Antigüedad media ponderada (años)	0,12

La vida residual media ponderada y la antigüedad media ponderada, se ha calculado en base al concepto de fallido y activo moroso que se recoge en la Escritura de Constitución del Fondo

4. Detalle Tipo de Interés

SITUACIÓN ACTUAL	
Tipo de Interés Fijo (% activo)	100,00%
Tipo de Interés Variable (% activo)	0,00%
Tipo Interés Medio Pond. (%)	3,00%
Margen Medio Pond. (%)	0,00%
Tipo de Interés Máximo	3,00%
Tipo de Interés Mínimo	3,00%

TIPO APLICADO	Nº DERECHOS DE CREDITO	PRINCIPAL PENDIENTE
<7,0	5	527.513 €
7,0 - 8,0	0	- €
8,0 - 9,0	0	- €
9,0 - 10,0	0	- €
10,0 - 11,0	0	- €
11,0 - 12,0	0	- €
12,0 - 13,0	0	- €
13,0 - 14,0	0	- €
14,0 - 15,0	0	- €
15,0 - 16,0	0	- €
16,0 - 17,0	0	- €
17,0 - 18,0	0	- €
18,0 - 19,0	0	- €
>19	0	- €
TOTAL	5	527.513 €

5. Detalle Distribución Geográfica

DISTRIBUCIÓN POR DEUDOR (Comunidad Autónoma)	Nº DERECHOS DE CRÉDITO	PRINCIPAL PENDIENTE	(%)
La Rioja	0	0 €	0,00%
País Vasco	0	0 €	0,00%
Cataluña	0	0 €	0,00%
Comunitat Valenciana	0	0 €	0,00%
No residente	0	0 €	0,00%
Comunidad Foral de Navarra	0	0 €	0,00%
Galicia	0	0 €	0,00%
Illes Balears	0	0 €	0,00%
Comunidad de Madrid	5	527.512 €	100,00%
Aragón	0	0 €	0,00%
Castilla-La Mancha	0	0 €	0,00%
Melilla	0	0 €	0,00%
Canarias	0	0 €	0,00%
Castilla y León	0	0 €	0,00%
Cantabria	0	0 €	0,00%
Andalucía	0	0 €	0,00%
Principado de Asturias	0	0 €	0,00%
Región de Murcia	0	0 €	0,00%
Extremadura	0	0 €	0,00%
Ceuta	0	0 €	0,00%
TOTAL	5	527.513 €	100,00%

CARTERA PAGARÉS

CARTERA DE PAGARES DE TITULIZACIÓN PENDIENTES DE VENCIMIENTO			
Fecha de Emisión	Fecha de Vencimiento	Importe Nominal	Precio de Emisión
12/12/2023	18/01/2024	12.105 €	12.087 €
12/12/2023	21/03/2024	199.355 €	198.540 €
15/12/2023	22/03/2024	146.483 €	145.896 €
22/12/2023	22/03/2024	167.522 €	166.898 €
TOTAL		525.467 €	523.420 €

CARTERA DE PAGARES DE TITULIZACIÓN VENCIDOS EN 2023			
Fecha de Emisión	Fecha de Vencimiento	Importe Nominal	Precio de Emisión
09/12/2022	18/01/2023	380.513 €	379.888 €
30/12/2022	31/01/2023	4.731.543 €	4.725.329 €
07/12/2022	27/03/2023	1.042.567 €	1.039.665 €
31/03/2023	10/05/2023	420.382 €	419.463 €
31/03/2023	10/05/2023	67.121 €	66.974 €
02/06/2023	16/08/2023	84.978 €	84.635 €
04/07/2023	11/10/2023	1.081.888 €	1.077.504 €
05/09/2023	18/10/2023	9.826.168 €	9.803.070 €
26/09/2023	15/11/2023	489.704 €	488.700 €
29/09/2023	15/11/2023	340.810 €	340.153 €
29/09/2023	15/11/2023	536.705 €	535.671 €
03/10/2023	22/11/2023	4.911.674 €	4.901.602 €
06/10/2023	22/11/2023	499.038 €	498.076 €
TOTAL		24.413.092 €	24.360.731 €

LIQUIDEZ

LIQUIDEZ CUENTAS DEL FONDO	
Cuenta de Tesorería	12.621 €
Cuenta de Compra	- €
Cuenta de Cobros	- €
Cuenta de Reservas	- €
TOTAL	12.621 €

INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO
a 31 de diciembre de 2023

COMPARTIMENTO EN DÓLARES

CARTERA DEL ACTIVO

1. Información general

INFORMACIÓN REFERENTE A LOS DERECHOS DE CREDITO A 31/12/2023	
Valor Nominal Pendiente de los Derechos de Crédito	\$22.947.921
Valor Nominal Medio de los Derechos de Crédito	\$866.244
Descuento Medio Anual de los Derechos de Crédito cedidos al Fondo	3,50%
Valor Contable de los Derechos de Crédito	\$22.783.227
Vencimiento Medio de los Derechos de Crédito (en días)	51,02
Vencimiento Máximo de los Derechos de Crédito (en días)	81,00
Vencimiento Mínimo de los Derechos de Crédito (en días)	18,00

2. Detalle de impagados

TOTAL IMPAGADOS			
	Nº de Derechos de Crédito	Saldo Pendiente Vencido	Saldo Financiado Pendiente Vencido
Hasta 1 mes	0	\$ 0,00	\$ 0,00
De 1 a 3 meses	0	\$ 0,00	\$ 0,00
De 3 a 6 meses	0	\$ 0,00	\$ 0,00
De 6 a 9 meses	0	\$ 0,00	\$ 0,00
De 9 a 12 meses	0	\$ 0,00	\$ 0,00
Más de 12 meses	0	\$ 0,00	\$ 0,00
TOTAL	0	\$ 0,00	\$ 0,00

3. Detalle Vida Residual

VIDA RESIDUAL ACTIVOS TITULIZADOS	
Vida	Principal Pendiente
Inferior a 1 año	\$22.947.921
Entre 1 y 2 años	\$0,00
Entre 2 y 3 años	\$0,00
Entre 3 y 4 años	\$0,00
Entre 4 y 5 años	\$0,00
Entre 5 y 6 años	\$0,00
Superior a 10 años	\$0,00
TOTAL	\$22.947.921
Vida residual media ponderada (años)	0,14
Antigüedad media ponderada (años)	0,11

La vida residual media ponderada y la antigüedad media ponderada, se ha calculado en base al concepto de fallido y activo moroso que se recoge en la Escritura de Constitución del Fondo

4. Detalle Tipo de Interés

SITUACIÓN ACTUAL	
Tipo de Interés Fijo (% activo)	100,00%
Tipo de Interés Variable (% activo)	0,00%
Tipo Interés Medio Pond. (%)	3,50%
Margen Medio Pond. (%)	0,00%
Tipo de Interés Máximo	3,50%
Tipo de Interés Mínimo	3,50%

TIPO APLICADO	Nº DERECHOS DE CRÉDITO	PRINCIPAL PENDIENTE
<7,0	27	\$22.947.921
7,0 - 8,0	0	\$0,00
8,0 - 9,0	0	\$0,00
9,0 - 10,0	0	\$0,00
10,0 - 11,0	0	\$0,00
11,0 - 12,0	0	\$0,00
12,0 - 13,0	0	\$0,00
13,0 - 14,0	0	\$0,00
14,0 - 15,0	0	\$0,00
15,0 - 16,0	0	\$0,00
16,0 - 17,0	0	\$0,00
17,0 - 18,0	0	\$0,00
18,0 - 19,0	0	\$0,00
>19	0	\$0,00
TOTAL	27	\$22.947.921

5. Detalle Distribución Geográfica

DISTRIBUCIÓN POR DEUDOR (Comunidad Autónoma)	Nº DERECHOS DE CRÉDITO	PRINCIPAL PENDIENTE	(%)
La Rioja	0	\$0	0,00%
País Vasco	0	\$0	0,00%
Cataluña	0	\$0	0,00%
Comunitat Valenciana	0	\$0	0,00%
Comunidad Foral de Navarra	0	\$0	0,00%
Galicia	0	\$0	0,00%
Illes Balears	0	\$0	0,00%
Comunidad de Madrid	27	\$22.947.921	100,00%
Aragón	0	\$0	0,00%
Castilla-La Mancha	0	\$0	0,00%
Melilla	0	\$0	0,00%
Canarias	0	\$0	0,00%
Castilla y León	0	\$0	0,00%
Cantabria	0	\$0	0,00%
Andalucía	0	\$0	0,00%
Principado de Asturias	0	\$0	0,00%
Región de Murcia	0	\$0	0,00%
Extremadura	0	\$0	0,00%
Ceuta	0	\$0	0,00%
TOTAL	27	\$22.947.921	100,00%

CARTERA PAGARÉS

CARTERA DE PAGARES DE TITULIZACIÓN PENDIENTES DE VENCIMIENTO			
Fecha de Emisión	Fecha de Vencimiento	Importe Nominal	Precio de Emisión
17/11/2023	18/01/2024	\$1.327.335	\$1.322.841
24/11/2023	18/01/2024	\$974.769	\$971.840
28/11/2023	18/01/2024	\$797.028	\$794.807
30/11/2023	22/02/2024	\$2.391.366	\$2.380.409
30/11/2023	18/01/2024	\$4.319.513	\$4.307.947
30/11/2023	21/02/2024	\$2.285.519	\$2.275.171
01/12/2023	21/03/2024	\$3.117.785	\$3.098.937
12/12/2023	21/03/2024	\$2.051.235	\$2.040.057
15/12/2023	14/03/2024	\$1.079.076	\$1.073.781
29/12/2023	12/02/2024	\$1.497.465	\$1.493.781
29/12/2023	14/03/2024	\$1.098.271	\$1.093.716
29/12/2023	14/03/2024	\$1.937.975	\$1.929.938
TOTAL		\$22.877.338	\$22.783.226

CARTERA DE PAGARES DE TITULIZACIÓN VENCIDOS 2023

Fecha de Emisión	Fecha de Vencimiento	Importe Nominal	Precio de Emisión
02/12/2022	18/01/2023	\$2.981.323	\$2.975.576
13/12/2022	18/01/2023	\$811.384	\$810.186
16/12/2022	18/01/2023	\$1.267.239	\$1.265.523
16/12/2022	22/02/2023	\$7.495.583	\$7.474.695
16/12/2022	23/03/2023	\$4.676.203	\$4.657.637
16/12/2022	18/01/2023	\$622.526	\$621.683
16/12/2022	18/01/2023	\$3.409.260	\$3.404.642
16/12/2022	18/01/2023	\$1.336.109	\$1.334.300
23/12/2022	18/01/2023	\$57.076	\$57.015
28/12/2022	18/01/2023	\$523.939	\$523.547
30/12/2022	31/01/2023	\$2.322.424	\$2.319.404
31/03/2023	10/05/2023	\$698.030	\$696.503
31/03/2023	19/04/2023	\$728.816	\$728.058
31/03/2023	10/05/2023	\$902.241	\$900.268
31/03/2023	10/05/2023	\$590.260	\$588.969
31/03/2023	10/05/2023	\$108.933	\$108.695
04/04/2023	10/05/2023	\$287.510	\$286.944
11/04/2023	10/05/2023	\$983.173	\$981.613
11/04/2023	19/04/2023	\$838.331	\$837.964
11/04/2023	10/05/2023	\$200.560	\$200.242
11/04/2023	10/05/2023	\$2.262.500	\$2.258.911
23/06/2023	16/10/2023	\$877.489	\$872.042
23/06/2023	08/11/2023	\$10.840.726	\$10.759.368
10/07/2023	16/10/2023	\$216.820	\$215.556
04/07/2023	18/10/2023	\$4.163.329	\$4.139.288
04/07/2023	25/10/2023	\$108.807	\$108.138
04/07/2023	11/10/2023	\$989.830	\$984.489
04/07/2023	18/10/2023	\$2.102.923	\$2.090.779
04/07/2023	25/10/2023	\$3.219.751	\$3.199.937
07/07/2023	08/11/2023	\$736.098	\$731.131
05/09/2023	18/10/2023	\$1.167.721	\$1.164.976
12/09/2023	18/10/2023	\$2.954.648	\$2.948.832
15/09/2023	18/10/2023	\$10.336.105	\$10.317.449
29/09/2023	15/11/2023	\$5.154.576	\$5.141.335
29/09/2023	20/11/2023	\$2.165.608	\$2.159.455
02/10/2023	15/11/2023	\$3.225.672	\$3.217.386
02/10/2023	15/11/2023	\$196.180	\$195.677
03/10/2023	15/11/2023	\$102.179	\$101.939
TOTAL		\$81.661.883	\$81.380.148

LIQUIDEZ

LIQUIDEZ CUENTAS DEL FONDO	
Cuenta de Tesorería	\$ 47.890
Cuenta de Compra	\$ 0
Cuenta de Cobros	\$ 0
TOTAL USD	\$ 47.890

**EBN ALPHA SECTOR PRIVADO
FONDO DE TITULIZACIÓN**

Información sobre el Fondo

ANEXO I

ALPHA EUR



Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT	5.05.1
Denominación del compartimento: 202100000	
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2023	
Entidades cedentes de los activos titulizados: ZEPA FINANCE, S.L.	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Hípothesis iniciales folleto/escritura			
	Tasa de activos dudosos	Tasa de falido	Tasa de recuperación fallidos	Tasa de amortización anticipada	Tasa de activos dudosos	Tasa de falido	Tasa de recuperación fallidos	Tasa de amortización anticipada	Tasa de activos dudosos	Tasa de falido	Tasa de recuperación fallidos	Tasa de amortización anticipada
Participaciones hipotecarias:	0380	0400	0420	0440	1380	1400	1420	1440	2380	2400	2420	2440
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	0401	0421	0441	1381	1401	1421	1441	2381	2401	2421	2441
Prestamos hipotecarios	0382	0402	0422	0442	1382	1402	1422	1442	2382	2402	2422	2442
Cédulas hipotecarias	0383	0403	0423	0443	1383	1403	1423	1443	2383	2403	2423	2443
Prestamos a promotores	0384	0404	0424	0444	1384	1404	1424	1444	2384	2404	2424	2444
Prestamos a PYMES	0385	0405	0425	0445	1385	1405	1425	1445	2385	2405	2425	2445
Prestamos a empresas:	0386	0406	0426	0446	1386	1406	1426	1446	2386	2406	2426	2446
Prestamos corporativos	0387	0407	0427	0447	1387	1407	1427	1447	2387	2407	2427	2447
Cédulas territoriales	0388	0408	0428	0448	1388	1408	1428	1448	2388	2408	2428	2448
Bonos de tesorería	0389	0409	0429	0449	1389	1409	1429	1449	2389	2409	2429	2449
Deuda subordinada	0390	0410	0430	0450	1390	1410	1430	1450	2390	2410	2430	2450
Creditos AAPP	0391	0411	0431	0451	1391	1411	1431	1451	2391	2411	2431	2451
Prestamos consumo	0392	0412	0432	0452	1392	1412	1432	1452	2392	2412	2432	2452
Prestamos automoción	0393	0413	0433	0453	1393	1413	1433	1453	2393	2413	2433	2453
Cuentas de arrendamiento financiero	0394	0414	0434	0454	1394	1414	1434	1454	2394	2414	2434	2454
Cuentas a cobrar	0395	0415	0435	0455	1395	1415	1435	0455	0415	0435	0455	0400
Derechos de crédito futuros	0396	0416	0436	0456	1396	1416	1436	1456	2396	2416	2436	2456
Bonos de titulización	0397	0417	0437	0457	1397	1417	1437	1457	2397	2417	2437	2457
Cédulas internacionalización	0398	0418	0438	0458	1398	1418	1438	1458	2398	2418	2438	2458
Otros:	0399	0419	0439	0459	1399	1419	1439	1459	2399	2419	2439	2459

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos	Importe impagado				Principal pendiente no vencido	Otros importes	Deuda Total
		Principal pendiente vencido	Intereses devengados en contabilidad	Intereses interrumpidos en contabilidad	Total			
Hasta 1 mes:	0460	0467	0474	0481	0488	0495	0502	0509
De 1 a 3 meses:	0461	0468	0475	0482	0489	0496	0503	0510
De 3 a 6 meses:	0462	0469	0476	0483	0490	0497	0504	0511
De 6 a 9 meses:	0463	0470	0477	0484	0491	0498	0505	0512
De 9 a 12 meses:	0464	0471	0478	0485	0492	0499	0506	0513
Más de 12 meses:	0465	0472	0479	0486	0493	0500	0507	0514
Total	0466	0473	0480	0487	0494	0501	0508	0515

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos	Importe impagado				Principal pendiente no vencido	Otros importes	Deuda Total	Valor garantía	Valor Garantía con Tasación > 2 años	% Deuda / v. Tasación
		Principal pendiente vencido	Intereses devengados en contabilidad	Intereses interrumpidos en contabilidad	Total						
Hasta 1 mes:	0515	0522	0529	0536	0543	0550	0557	0564	0571	0578	0584
De 1 a 3 meses:	0516	0523	0530	0537	0544	0551	0558	0565	0572	0579	0585
De 3 a 6 meses:	0517	0524	0531	0538	0545	0552	0559	0566	0573	0580	0586
De 6 a 9 meses:	0518	0525	0532	0539	0546	0553	0560	0567	0574	0581	0587
De 9 a 12 meses:	0519	0526	0533	0540	0547	0554	0561	0568	0575	0582	0588
Más de 12 meses:	0520	0527	0534	0541	0548	0555	0562	0569	0576	0583	0589
Total	0521	0528	0535	0542	0549	0556	0563	0570	0577		0590

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 19/01/2021			
Inferior a 1 año	0600	523	1600	6.145	2600	128.654
Entre 1 y 2 años	0601		1601		2601	
Entre 2 y 3 años	0602		1602		2602	
Entre 3 y 4 años	0603		1603		2603	
Entre 4 y 5 años	0604		1604		2604	
Entre 5 y 10 años	0605		1605		2605	
Superior a 10 años	0606		1606		2606	
Total	0607	523	1607	6.145	2607	128.654
Vida residual media ponderada (años)	0608	0,22	1608	0,11	2608	0,19

Antigüedad	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 19/01/2021			
Antigüedad media ponderada (años)	0609	0,11	1609	0,11	2609	0,06

CUADRO D									
Importe pendiente activos titulados / Valor garantía (miles de euros)									
	Situación actual 31/12/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 19/01/2021		
	Nº de activos vivos	Principal pendiente		Nº de activos vivos	Principal pendiente		Nº de activos vivos	Principal pendiente	
0% - 40%	0620	0630		1620	1630		2620	2630	
40% - 60%	0621	0631		1621	1631		2621	2631	
60% - 80%	0622	0632		1622	1632		2622	2632	
80% - 100%	0623	0633		1623	1633		2623	2633	
100% - 120%	0624	0634		1624	1634		2624	2634	
120% - 140%	0625	0635		1625	1635		2625	2635	
140% - 160%	0626	0636		1626	1636		2626	2636	
superior al 160%	0627	0637		1627	1637		2627	2637	
Total	0628	0638		1628	1638		2628	2638	
Media ponderada (%)	0639	0649		1639	1649		2639	2649	

CUADRO E					
Tipos de interés de los activos titulados (%)		Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022	
Tipo de interés medio ponderado		0650	3,00	1650	3,00
Tipo de interés nominal máximo		0651	3,00	1651	3,00
Tipo de interés nominal mínimo		0652	3,00	1652	3,00

CUADRO F									
Distribución geográfica activos titulados (miles de euros)									
	Situación actual 31/12/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 19/01/2021		
	Nº de activos vivos	Principal pendiente		Nº de activos vivos	Principal pendiente		Nº de activos vivos	Principal pendiente	
Andalucía	0660	0663	0	1660	1663	0	2660	2663	0
Aragón	0661	0664	0	1661	1664	0	2661	2664	0
Asturias	0662	0665	0	1662	1665	0	2662	2665	0
Baleares	0663	0666	0	1663	1666	0	2663	2666	0
Canarias	0664	0667	0	1664	1667	0	2664	2667	0
Cantabria	0665	0668	0	1665	1668	0	2665	2668	0
Castilla-Lesn	0666	0669	0	1666	1669	0	2666	2669	0
Castilla La Mancha	0667	0670	0	1667	1670	0	2667	2670	0
Cataluña	0668	0671	0	1668	1671	0	2668	2671	0
Ciudad	0669	0672	0	1669	1672	0	2669	2672	0
Extremadura	0670	0673	0	1670	1673	0	2670	2673	0
Galicia	0671	0674	0	1671	1674	0	2671	2674	0
Madrid	0672	0675	523	1672	1675	6.145	2672	2675	120.664
Navarra	0673	0676	0	1673	1676	0	2673	2676	0
Murcia	0674	0677	0	1674	1677	0	2674	2677	0
País Vasco	0675	0678	0	1675	1678	0	2675	2678	0
La Rioja	0676	0679	0	1676	1679	0	2676	2679	0
Comunidad Valenciana	0677	0680	0	1677	1680	0	2677	2680	0
País Vasco	0678	0681	0	1678	1681	0	2678	2681	0
Total España	0679	0702	523	1679	1702	6.145	2679	2702	128.664
Otros países Unión Europea	0680	0703	0	1680	1703	0	2680	2703	0
Resto	0681	0704	0	1681	1704	0	2681	2704	0
Total general	0682	0705	523	1682	1705	6.145	2682	2705	128.664

CUADRO G									
Concentración									
	Situación actual 31/12/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 19/01/2021		
	Porcentaje	CNAE		Porcentaje	CNAE		Porcentaje	CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	100,00		1710	100,00		2710	99,66	
Sector	0711	59,76	0712	7,112	1711	76,90	1712	9,499	2711
								83,29	2712
									7,112



Dirección General de Mercados
Edificio A, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT

5.05.2	
Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT	
Denominación del compartimento: 202100000	
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 31/12/2023	
Mercados de cotización de los valores emitidos:	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A										
(miles de euros)										
Serie	Denominación serie	Situación actual 31/12/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 19/01/2021		
		Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722
	PAGARE 1 EUR	1	0	0	1	0	0	1	925.722	923
	PAGARE 2 EUR	1	0	0	1	0	0	1	633.164	630
	PAGARE 3 EUR	1	0	0	1	0	0	1	132.304	132
	PAGARE 4 EUR	1	0	0	1	0	0	1	59.553	59
	PAGARE 5 EUR	1	0	0	1	0	0	1	567.760	565
	PAGARE 6 EUR	1	0	0	1	0	0	1	402.139	400
	PAGARE 7 EUR	1	0	0	1	0	0	1	230.375	229
	PAGARE 8 EUR	1	0	0	1	0	0	1	4.474.043	4.448
	PAGARE 9 EUR	1	0	0	1	0	0	1	2.052.457	2.045
	PAGARE 10 EUR	1	0	0	1	0	0	1	671.134	660
	PAGARE 11 EUR	1	0	0	1	0	0	1	299.762	300
	PAGARE 12 EUR	1	0	0	1	0	0	1	164.206	164
	PAGARE 13 EUR	1	0	0	1	0	0	1	193.204	193
	PAGARE 14 EUR	1	0	0	1	0	0	1	811.550	811
	PAGARE 15 EUR	1	0	0	1	0	0	1	44.006	44
	PAGARE 16 EUR	1	0	0	1	0	0	1	432.952	432
	PAGARE 17 EUR	1	0	0	1	0	0	1	439.011	439
	PAGARE 18 EUR	1	0	0	1	0	0	1	147.006	147
	PAGARE 19 EUR	1	0	0	1	0	0	1	910.010	910
	PAGARE 20 EUR	1	0	0	1	0	0	1	264.523	264
	PAGARE 21 EUR	1	0	0	1	0	0	1	280.509	280
	PAGARE 22 EUR	1	0	0	1	0	0	1	247.176	247
	PAGARE 23 EUR	1	0	0	1	0	0	1	2.236.012	2.235
	PAGARE 24 EUR	1	0	0	1	0	0	1	33.590	34
	PAGARE 25 EUR	1	0	0	1	0	0	1	37.741	30
	PAGARE 26 EUR	1	0	0	1	0	0	1	215.564	215

PAGARE 27 EUR	1	0	0	1	0	0	1	113.953	113				
PAGARE 28 EUR	1	0	0	1	0	0	1	245.274	244				
PAGARE 29 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.030.085	1.021				
PAGARE 30 EUR	1	0	0	1	0	0	1	264.571	263				
PAGARE 31 EUR	1	0	0	1	0	0	1	591.753	589				
PAGARE 32 EUR	1	0	0	1	0	0	1	119.245	119				
PAGARE 33 EUR	1	0	0	1	0	0	1	107.979	107				
PAGARE 34 EUR	1	0	0	1	0	0	1	90.617	90				
PAGARE 35 EUR	1	0	0	1	0	0	1	720.163	725				
PAGARE 36 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.559.437	1.553				
PAGARE 37 EUR	1	0	0	1	0	0	1	407.535	407				
PAGARE 38 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.962.593	1.954				
PAGARE 39 EUR	1	0	0	1	0	0	1	247.034	247				
PAGARE 40 EUR	1	0	0	1	0	0	1	200.383	200				
PAGARE 41 EUR	1	0	0	1	0	0	1	36.140	36				
PAGARE 42 EUR	1	0	0	1	0	0	1	296.901	296				
PAGARE 43 EUR	1	0	0	1	0	0	1	200.546	207				
PAGARE 44 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.073.620	1.069				
PAGARE 45 EUR	1	0	0	1	0	0	1	330.922	331				
PAGARE 46 EUR	1	0	0	1	0	0	1	102.114	102				
PAGARE 47 EUR	1	0	0	1	0	0	1	136.756	137				
PAGARE 48 EUR	1	0	0	1	0	0	1	214.093	213				
PAGARE 49 EUR	1	0	0	1	0	0	1	593.597	591				
PAGARE 50 EUR	1	0	0	1	0	0	1	819.260	818				
PAGARE 51 EUR	1	0	0	1	0	0	1	204.226	203				
PAGARE 52 EUR	1	0	0	1	0	0	1	754.131	751				
PAGARE 53 EUR	1	0	0	1	0	0	1	204.550	204				
PAGARE 54 EUR	1	0	0	1	0	0	1	366.319	365				
PAGARE 55 EUR	1	0	0	1	0	0	1	845.262	841				
PAGARE 56 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.203.216	1.279				
PAGARE 57 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.226.112	1.231				
PAGARE 58 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.273.336	1.272				
PAGARE 59 EUR	1	0	0	1	0	0	1	979.375	976				
PAGARE 60 EUR	1	0	0	1	0	0	1	16.564.89	16.505				
PAGARE 61 EUR	1	0	0	1	0	0	1	8.270.531	8.245				
PAGARE 62 EUR	1	0	0	1	0	0	1	12.502.48	12.457				
PAGARE 63 EUR	1	0	0	1	0	0	1	2.373.444	2.366				
PAGARE 64 EUR	1	0	0	1	0	0	1	716.711	715				
PAGARE 65 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.930.935	1.927				
PAGARE 66 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.315.333	1.314				
PAGARE 67 EUR	1	0	0	1	0	0	1	19.215.19	19.190				
PAGARE 68 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.520.014	1.519				
PAGARE 69 EUR	1	0	0	1	0	0	1	997.443	993				
PAGARE 70 EUR	1	0	0	1	0	0	1	622.710	619				
PAGARE 71 EUR	1	0	0	1	1.042.567	1.040	1	1.042.567	1.040				
PAGARE 72 EUR	1	0	0	1	300.513	300	1	300.513	300				
PAGARE 73 EUR	1	0	0	1	4.731.543	4.725	1	4.731.543	4.725				
PAGARE 74 EUR	1	0	0	0	0	0	1	420.302	419				
PAGARE 75 EUR	1	0	0	0	0	0	1	67.121	67				
PAGARE 76 EUR	1	0	0	0	0	0	1	84.973	85				
PAGARE 77 EUR	1	0	0	0	0	0	1	1.001.000	1.078				
PAGARE 78 EUR	1	0	0	0	0	0	1	9.026.160	9.003				
PAGARE 79 EUR	1	0	0	0	0	0	1	409.704	409				
PAGARE 80 EUR	1	0	0	0	0	0	1	340.010	340				
PAGARE 81 EUR	1	0	0	0	0	0	1	536.705	536				
PAGARE 82 EUR	1	0	0	0	0	0	1	4.911.074	4.902				
PAGARE 83 EUR	1	0	0	0	0	0	1	499.030	499				
PAGARE 84 EUR	1	12.105	12	0	0	0	1	12.105	12				
PAGARE 85 EUR	1	199.355	199	0	0	0	1	199.355	199				
PAGARE 86 EUR	1	146.403	146	0	0	0	1	146.403	146				
PAGARE 87 EUR	1	167.522	167	0	0	0	1	167.522	167				
Total		0723	07	0724	523	1723	73	1724	6.145	2723	07	2724	120.654

CUADRO B

Serie	(miles de euros)		Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses		Serie divergencia intereses en el período	Principal pendiente		Total Pendiente	Correcciones de valor por reposición de pérdidas
	Denominación serie	Grado de subordinación				Intereses Acumulados	Intereses Impagados		Principal no vencido	Principal impagado		
PAGARE 1 EUR	NS	FUO	0,00	1,01	0	0	NO	0	0	0	0	0
PAGARE 2 EUR	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0	0
PAGARE 3 EUR	NS	FUO	0,00	1,95	0	0	NO	0	0	0	0	0
PAGARE 4 EUR	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0	0
PAGARE 5 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
PAGARE 6 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
PAGARE 7 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
PAGARE 8 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0	0
PAGARE 9 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0	0
PAGARE 10 EUR	NS	FUO	0,00	1,47	0	0	NO	0	0	0	0	0
PAGARE 11 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
PAGARE 12 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
PAGARE 13 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
PAGARE 14 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
PAGARE 15 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0

PAGARE 66 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 67 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 68 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 69 EUR	NS	FUO	0,00	2,29	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 70 EUR	NS	FUO	0,00	2,73	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 71 EUR	NS	FUO	0,00	0,92	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 72 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 73 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 74 EUR	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 75 EUR	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 76 EUR	NS	FUO	0,00	1,97	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 77 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 78 EUR	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 79 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 80 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 81 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 82 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 83 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
PAGARE 84 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	12	0	12	0	0	0			
PAGARE 85 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	199	0	199	0	0	0			
PAGARE 86 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	146	0	146	0	0	0			
PAGARE 87 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	167	0	167	0	0	0			
Total					0740	0	0741	0	0743	523	0744	0	0745	524	0746	0

	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 19/01/2021
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	1,49	0748
		0749	1,40
		0749	1,63

CUADRO C

Serie	Denominación serie	Situación actual 31/12/2023				Situación periodo comparativo anterior 31/12/2022			
		Amortización principal		Intereses		Amortización principal		Intereses	
		Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753
PAGARE 1 EUR		0	923	0	2	0	923	0	2
PAGARE 2 EUR		0	630	0	3	0	630	0	3
PAGARE 3 EUR		0	132	0	1	0	132	0	1
PAGARE 4 EUR		0	59	0	0	0	59	0	0
PAGARE 5 EUR		0	565	0	2	0	565	0	2
PAGARE 6 EUR		0	400	0	1	0	400	0	1
PAGARE 7 EUR		0	229	0	1	0	229	0	1
PAGARE 8 EUR		0	4.440	0	21	0	4.440	0	21
PAGARE 9 EUR		0	2.265	0	14	0	2.265	0	14
PAGARE 10 EUR		0	660	0	2	0	660	0	2
PAGARE 11 EUR		0	300	0	0	0	300	0	0
PAGARE 12 EUR		0	164	0	0	0	164	0	0
PAGARE 13 EUR		0	193	0	0	0	193	0	0
PAGARE 14 EUR		0	311	0	1	0	311	0	1
PAGARE 15 EUR		0	44	0	0	0	44	0	0
PAGARE 16 EUR		0	432	0	0	0	432	0	0
PAGARE 17 EUR		0	439	0	0	0	439	0	0
PAGARE 18 EUR		0	147	0	0	0	147	0	0
PAGARE 19 EUR		0	910	0	1	0	910	0	1
PAGARE 20 EUR		0	264	0	0	0	264	0	0
PAGARE 21 EUR		0	200	0	0	0	200	0	0
PAGARE 22 EUR		0	247	0	0	0	247	0	0
PAGARE 23 EUR		0	2.235	0	1	0	2.235	0	1
PAGARE 24 EUR		0	34	0	0	0	34	0	0
PAGARE 25 EUR		0	30	0	0	0	30	0	0

PAGARE 26 EUR	0	215	0	0	0	215	0	0								
PAGARE 27 EUR	0	113	0	1	0	113	0	1								
PAGARE 28 EUR	0	244	0	1	0	244	0	1								
PAGARE 29 EUR	0	1.821	0	7	0	1.821	0	7								
PAGARE 30 EUR	0	263	0	1	0	263	0	1								
PAGARE 31 EUR	0	509	0	2	0	509	0	2								
PAGARE 32 EUR	0	119	0	0	0	119	0	0								
PAGARE 33 EUR	0	187	0	1	0	187	0	1								
PAGARE 34 EUR	0	90	0	0	0	90	0	0								
PAGARE 35 EUR	0	725	0	3	0	725	0	3								
PAGARE 36 EUR	0	1.553	0	5	0	1.553	0	5								
PAGARE 37 EUR	0	407	0	0	0	407	0	0								
PAGARE 38 EUR	0	1.954	0	7	0	1.954	0	7								
PAGARE 39 EUR	0	247	0	247	0	247	0	247								
PAGARE 40 EUR	0	200	0	200	0	200	0	200								
PAGARE 41 EUR	0	36	0	0	0	36	0	0								
PAGARE 42 EUR	0	296	0	1	0	296	0	1								
PAGARE 43 EUR	0	287	0	1	0	287	0	1								
PAGARE 44 EUR	0	1.069	0	4	0	1.069	0	4								
PAGARE 45 EUR	0	331	0	0	0	331	0	0								
PAGARE 46 EUR	0	102	0	0	0	102	0	0								
PAGARE 47 EUR	0	137	0	0	0	137	0	0								
PAGARE 48 EUR	0	213	0	1	0	213	0	1								
PAGARE 49 EUR	0	591	0	2	0	591	0	2								
PAGARE 50 EUR	0	810	0	1	0	810	0	1								
PAGARE 51 EUR	0	203	0	1	0	203	0	1								
PAGARE 52 EUR	0	751	0	2	0	751	0	2								
PAGARE 53 EUR	0	204	0	1	0	204	0	1								
PAGARE 54 EUR	0	365	0	1	0	365	0	1								
PAGARE 55 EUR	0	941	0	3	0	941	0	3								
PAGARE 56 EUR	0	1.279	0	3	0	1.279	0	3								
PAGARE 57 EUR	0	1.222	0	3	0	1.222	0	3								
PAGARE 58 EUR	0	1.872	0	5	0	1.872	0	5								
PAGARE 59 EUR	0	916	0	3	0	916	0	3								
PAGARE 60 EUR	0	16.505	0	49	0	16.505	0	49								
PAGARE 61 EUR	0	8.240	0	24	0	8.240	0	24								
PAGARE 62 EUR	0	12.457	0	37	0	12.457	0	37								
PAGARE 63 EUR	0	2.366	0	6	0	2.366	0	6								
PAGARE 64 EUR	0	715	0	1	0	715	0	1								
PAGARE 65 EUR	0	1.927	0	3	0	1.927	0	3								
PAGARE 66 EUR	0	1.314	0	1	0	1.314	0	1								
PAGARE 67 EUR	0	19.190	0	14	0	19.190	0	14								
PAGARE 68 EUR	0	993	0	4	0	993	4	4								
PAGARE 69 EUR	0	1.519	0	1	1.519	1.519	1	1								
PAGARE 70 EUR	0	619	0	3	619	619	3	3								
PAGARE 71 EUR	0	1.040	0	2	0	0	0	0								
PAGARE 72 EUR	0	300	0	1	0	0	0	0								
PAGARE 73 EUR	0	4.725	0	5	0	0	0	0								
PAGARE 74 EUR	0	419	0	1	0	0	0	0								
PAGARE 75 EUR	0	67	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 76 EUR	0	85	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 77 EUR	1.070	1.070	4	4	0	0	0	0								
PAGARE 78 EUR	9.203	9.203	19	19	0	0	0	0								
PAGARE 79 EUR	409	409	1	1	0	0	0	0								
PAGARE 80 EUR	340	340	1	1	0	0	0	0								
PAGARE 81 EUR	536	536	1	1	0	0	0	0								
PAGARE 82 EUR	4.902	4.902	9	9	0	0	0	0								
PAGARE 83 EUR	490	490	1	1	0	0	0	0								
PAGARE 84 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 85 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 86 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 87 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0								
Total	0754	17.645	0755	128.130	0756	33	0757	754	1754	3.131	1755	103.770	1756	0	1757	711

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 19/01/2021	
inferior a 1 año	0765	523	1765	6.145	2765	128.654
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	
Entre 5 y 10 años	0770		1770		2770	
Superior a 10 años	0771		1771		2771	
Total	0772	523	1772	6.145	2772	128.654
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,26	1773	0,12	2773	0,18



Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT
Denominación del compartimento: 202100000
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejores crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 19/01/2021
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	1775	2775
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	1776	2776
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	1777	2777
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	1778	2778
1.4 Rating de la contrapartida	0779	1779	2779
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	1780	2780
2 Importe disponible de la línea de liquidez (miles de euros)	0781	1781	2781
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	1782	2782
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	1783	2783
2.3 Rating de la contrapartida	0784	1784	2784
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785	1785	2785
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avalista (miles de euros)	0786	1786	2786
3.1 Porcentaje que representan los avalistas sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	1787	2787
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	1788	2788
3.3 Rating del avalista	0789	1789	2789
3.4 Rating requerido del avalista	0790	1790	2790
4 Subordinación de series (S/N)	0791	1791	2791
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100,00	1792
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793	1793	2793
5.1 Denominación de la contrapartida	0794	1794	2794
5.2 Rating de la contrapartida	0795	1795	2795
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796	1796	2796

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)			Valor en libros (miles de euros)		Otras características
	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 19/01/2021	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	
Naturaleza riesgo cubierto						
Prestamos hipotecarios	0811	1811	2811	0829	1829	3829
Cédulas hipotecarias	0812	1812	2812	0830	1830	3830
Prestamos a promotores	0813	1813	2813	0831	1831	3831
Prestamos a PYMES	0814	1814	2814	0832	1832	3832
Prestamos a empresas	0815	1815	2815	0833	1833	3833
Prestamos corporativos	0816	1816	2816	0834	1834	3834
Cédulas temporales	0817	1817	2817	0835	1835	3835
Bonos de tesorería	0818	1818	2818	0836	1836	3836
Deuda subordinada	0819	1819	2819	0837	1837	3837
Créditos AAPP	0820	1820	2820	0838	1838	3838
Prestamos consumo	0821	1821	2821	0839	1839	3839
Prestamos automoción	0822	1822	2822	0840	1840	3840
Cuentas de arrendamiento financiero (leasing)	0823	1823	2823	0841	1841	3841
Cuentas a cobrar	0824	1824	2824	0842	1842	3842
Derechos de crédito futuros	0825	1825	2825	0843	1843	3843
Bonos de titulización	0826	1826	2826	0844	1844	3844
Total	0827	1827	2827	0845	1845	3845

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT
Denominación del compartimento: 202100000
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2023

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago	Días impago	Importe impagado acumulado		Ratio			Ref. Folleto						
			Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Última Fecha Pago							
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	7002	360	7003	0	7006	0	7009	0,00	7012	0,00	7015	0,00	
2. Activos Morosos por otras razones				7004	7007		7010		7013		7016		7019	
Total Morosos				7005	7008		7011		7014		7017		7020	7018
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	7020		7021	7024		7027		7030		7033		7036	
4. Activos Fallidos por otras razones				7022	7025		7028		7031		7034		7037	
Total Fallidos				7023	7026		7029		7032		7035		7038	7036

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto
	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Última Fecha Pago	
0850		1850	2850	3850
0851		1851	2851	3851
0852		1852	2852	3852
0853		1853	2853	3853

CUADRO B				
TRIGGERS	Limite	% Actual	Ultima Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0054	0050	1050	2050
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0055	0059	1059	2059
No Reducción del Fondo de Reserva	0056	0060	1060	2060
OTROS TRIGGERS	0057	0061	1061	2061

Cuadro de texto libre

CUADRO C
Informe cumplimiento reglas de funcionamiento




Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

La información más relevante acerca del grado de cumplimiento de las reglas de funcionamiento del Fondo, previstas en la escritura de constitución de Fondo, ya se ha reflejado dentro del apartado de ratios que figura en los Estados S.05.4 cuadro A.

No se cumplimenta el Estado S.05.4 cuadro B, por no establecerse en la Escritura de constitución del Fondo ningún trigger en relación a la amortización secuencial y al diferimiento de intereses

Así mismo, no se cumplimenta la parte de los triggers para la no reducción del Fondo de Reserva, dado que este Fondo no tiene Fondo de Reserva ni Fondo de Liquidez, El Fondo tiene una Reserva para Gastos, la cual no tiene triggers y que puede utilizar durante el primer año de vida del mismo a contar desde la Fecha de Constitución. Dicha Reserva ya se ha devuelto al Cedente.



Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT	S.05.5
Denominación del compartimento: 202100000	
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2023	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartido	Importe fijo (miles de euros)	Criterios determinación de la comisión		Máximo (miles de euros)	Mínimo (miles de euros)	Periodicidad pago según folleto / escritura	Condiciones iniciales folleto / escritura emisión	Otras consideraciones				
			Base de cálculo	% anual									
Comisión sociedad gestora	0062 EBN TITULIZACION SAU, S.G.F.T.	1062	2062	SALDO MEDIO VALOR NOMINAL DC	3062	0.500	4062	10	0062 TRIMESTRAL	7062	N	0062	EL MÍNIMO ES ANUALMENTE
Comisión administrador	0063 BORROR FINANCE S.L.	1063	2063	SALDO MEDIO VALOR NOMINAL DC	3063	0.500	4063		0063 TRIMESTRAL	7063	N	0063	
Comisión del agente financiero/pagos	0064 EBN BANCO DE NEGOCIOS, S.A.	1064	2064		3064		4064		0064 TRIMESTRAL	7064	N	0064	EN FUNCION DEL NÚMERO DE TRANSFERENCIAS
Otras	0065	1065	2065		3065		4065		0065	7065		0065	



Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

	S.06
Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT	
Denominación del compartimento: 202100000	
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2023	
NOTAS EXPLICATIVAS	
	
INFORME DE AUDITOR	
INFORME SOBRE EL CUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE RIESGOS	



Notas Explicativas

El fondo no mantiene activos disponibles para la venta ni cobertura de flujos de efectivo, por tanto, no hay para cumplimentar en el S.04

En S01:

La casilla 0157, denominada "otros", incluye las partidas:

- Auditoría: -5.102,06€
- CNMV: -364€.
- AEAT: -7.830,11€.

ALPHA USD



Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 300, www.cnmv.es

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT	S.05.1
Denominación del compartimento: 202100002	
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2023	
Entidades cedentes de los activos titulizados: ZEPA FINANCE, S.L.	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Hipótesis iniciales folleto/esortura			
	Tasa de activos dudosos	Tasa de folleto	Tasa de recuperación folleto	Tasa de amortización anticipada	Tasa de activos dudosos	Tasa de folleto	Tasa de recuperación folleto	Tasa de amortización anticipada	Tasa de activos dudosos	Tasa de folleto	Tasa de recuperación folleto	Tasa de amortización anticipada
Participaciones hipotecarias	0300	0400	0420	0480	1300	1400	1420	1440	2300	2400	2420	2440
Certificados de transmisión de hipoteca	0301	0401	0421	0441	1301	1401	1421	1441	2301	2401	2421	2441
Préstamos hipotecarios	0302	0402	0422	0442	1302	1402	1422	1442	2302	2402	2422	2442
Cédulas hipotecarias	0303	0403	0423	0443	1303	1403	1423	1443	2303	2403	2423	2443
Préstamos a promotores	0304	0404	0424	0444	1304	1404	1424	1444	2304	2404	2424	2444
Préstamos a PYMEs	0305	0405	0425	0445	1305	1405	1425	1445	2305	2405	2425	2445
Préstamos a empresas	0306	0406	0426	0446	1306	1406	1426	1446	2306	2406	2426	2446
Préstamos corporativos	0307	0407	0427	0447	1307	1407	1427	1447	2307	2407	2427	2447
Cédulas territoriales	0308	0408	0428	0448	1308	1408	1428	1448	2308	2408	2428	2448
Bonos de tesorería	0309	0409	0429	0449	1309	1409	1429	1449	2309	2409	2429	2449
Deuda subordinada	0390	0410	0430	0450	1390	1410	1430	1450	2390	2410	2430	2450
Creditos AAPP	0391	0411	0431	0451	1391	1411	1431	1451	2391	2411	2431	2451
Préstamos consumo	0392	0412	0432	0452	1392	1412	1432	1452	2392	2412	2432	2452
Préstamos automoción	0393	0413	0433	0453	1393	1413	1433	1453	2393	2413	2433	2453
Cuentas de arrendamiento financiero (leasing)	0394	0414	0434	0454	1394	1414	1434	1454	2394	2414	2434	2454
Cuentas a cobrar	0395	0415	0435	0455	1395	1415	1435	1455	2395	2415	2435	2455
Derechos de crédito futuro	0396	0416	0436	0456	1396	1416	1436	1456	2396	2416	2436	2456
Bonos de titulización	0397	0417	0437	0457	1397	1417	1437	1457	2397	2417	2437	2457
Cédulas internacionalización	0398	0418	0438	0458	1398	1418	1438	1458	2398	2418	2438	2458
Otros	0399	0419	0439	0459	1399	1419	1439	1459	2399	2419	2439	2459

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos	Importe impagado			Principal pendiente no vencido	Otros importes	Deuda Total
		Principal pendiente vencido	Intereses devengados en contabilidad	Intereses interrumpidos en contabilidad			
Hasta 1 mes	0460	0467	0474	0481	0495	0502	0509
De 1 a 3 meses	0461	0468	0475	0482	0496	0503	0510
De 3 a 6 meses	0462	0469	0476	0483	0497	0504	0511
De 6 a 9 meses	0463	0470	0477	0484	0498	0505	0512
De 9 a 12 meses	0464	0471	0478	0485	0499	0506	0513
Más de 12 meses	0465	0472	0479	0486	0500	0507	0514
Total	0466	0473	0480	0487	0494	0501	0508

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos	Importe impagado			Principal pendiente no vencido	Otros importes	Deuda Total	Valor garantía	Valor Garantía con Tasaación > 2 años	% Deuda / v. Tasaación
		Principal pendiente vencido	Intereses devengados en contabilidad	Intereses interrumpidos en contabilidad						
Hasta 1 mes	0515	0522	0529	0536	0550	0557	0564	0571	0578	0584
De 1 a 3 meses	0516	0523	0530	0537	0544	0551	0558	0565	0572	0579
De 3 a 6 meses	0517	0524	0531	0538	0545	0552	0559	0566	0573	0580
De 6 a 9 meses	0518	0525	0532	0539	0546	0553	0560	0567	0574	0581
De 9 a 12 meses	0519	0526	0533	0540	0547	0554	0561	0568	0575	0582
Más de 12 meses	0520	0527	0534	0541	0548	0555	0562	0569	0576	0583
Total	0521	0528	0535	0542	0549	0556	0563	0570	0577	0584

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente			
	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022	
Inferior a 1 año	0600	20.610	1600	23.855
Entre 1 y 2 años	0601		1601	2601
Entre 2 y 3 años	0602		1602	2602
Entre 3 y 4 años	0603		1603	2603
Entre 4 y 5 años	0604		1604	2604
Entre 5 y 10 años	0605		1605	2605
Superior a 10 años	0606		1606	2606
Total	0607	20.610	1607	23.855
Vida residual media ponderada (años)	0608	0,14	1608	0,11

Antigüedad	Situación actual 31/12/2023			
	Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 19/01/2021	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	0,10	1609	0,06

CUADRO D						
Importe pendiente activos titulados / Valor garantía (miles de euros)						
	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 19/01/2021	
	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente
0% - 40%	0620	0630	1620	1630	2620	2630
40% - 60%	0621	0631	1621	1631	2621	2631
60% - 80%	0622	0632	1622	1632	2622	2632
80% - 100%	0623	0633	1623	1633	2623	2633
100% + 120%	0624	0634	1624	1634	2624	2634
120% + 140%	0625	0635	1625	1635	2625	2635
140% + 160%	0626	0636	1626	1636	2626	2636
superior al 160%	0627	0637	1627	1637	2627	2637
Total	0628	0638	1628	1638	2628	2638
Media ponderada (%)	0639	0649	1639	1649	2639	2649

CUADRO E							
Tipos de interés de los activos titulados (%)		Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 19/01/2021	
Tipo de interés medio ponderado		0650	3,50	1650	3,00	2650	3,11
Tipo de interés nominal máximo		0651	3,50	1651	3,00	2651	3,50
Tipo de interés nominal mínimo		0652	3,50	1652	3,00	2652	3,00

CUADRO F												
Distribución geográfica activos titulados (miles de euros)												
	Situación actual 31/12/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 19/01/2021					
	Nº de activos vivos	Principal pendiente	CHAE	Nº de activos vivos	Principal pendiente	CHAE	Nº de activos vivos	Principal pendiente	CHAE			
Andalucía	0660	0	0663	0	1660	0	1683	0	2660	0	2683	0
Aragón	0661	0	0664	0	1661	0	1684	0	2661	0	2684	0
Asturias	0662	0	0665	0	1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663	0	0666	0	1663	0	1686	0	2663	0	2686	0
Canarias	0664	0	0667	0	1664	0	1687	0	2664	0	2687	0
Cantabria	0665	0	0668	0	1665	0	1688	0	2665	0	2688	0
Castilla-L León	0666	0	0669	0	1666	0	1689	0	2666	0	2689	0
Castilla La Mancha	0667	0	0670	0	1667	0	1690	0	2667	0	2690	0
Cataluña	0668	0	0671	0	1668	0	1691	0	2668	0	2691	0
Ceuta	0669	0	0672	0	1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670	0	0673	0	1670	0	1693	0	2670	0	2693	0
Galicia	0671	0	0674	0	1671	0	1694	0	2671	0	2694	0
Madrid	0672	27	0695	20.615	1672	43	1695	23.855	2672	716	2695	292.041
Murcia	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Narva	0674	0	0697	0	1674	0	1697	0	2674	0	2697	0
Navarra	0675	0	0698	0	1675	0	1698	0	2675	0	2698	0
La Rioja	0676	0	0699	0	1676	0	1699	0	2676	0	2699	0
Comunidad Valenciana	0677	0	0700	0	1677	0	1700	0	2677	0	2700	0
País Vasco	0678	0	0701	0	1678	0	1701	0	2678	0	2701	0
Total España	0679	27	0702	20.615	1679	43	1702	23.855	2679	716	2702	292.041
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	27	0705	20.615	1682	43	1705	23.855	2682	716	2705	292.041

CUADRO G												
Concentración												
	Situación actual 31/12/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 19/01/2021					
	Porcentaje	CHAE	CHAE	Porcentaje	CHAE	CHAE	Porcentaje	CHAE	CHAE			
Cinco primeros deudores/emisores con más concentración	0710	100,00		1710	100,00		2710	99,90				
Sector	0711	72,77	0712	7.112	1711	81,30	1712	9.299	2711	73,76	2712	7.112



Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 300, www.cnmv.es

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT	5.05.2
Denominación del compartimento: 202100002	
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 31/12/2023	
Mercados de cotización de los valores emitidos:	

INFORMACIÓN RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A											
(miles de euros)											
Serie	Denominación serie	Situación actual 31/12/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 19/01/2021			
		Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	
	PAGARE 1 USD	0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722	
	PAGARE 2 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.597.177	1.590	
	PAGARE 3 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.161.100	1.156	
	PAGARE 4 USD	1	0	0	1	0	0	1	399.326	393	
	PAGARE 5 USD	1	0	0	1	0	0	1	454.056	452	
	PAGARE 6 USD	1	0	0	1	0	0	1	190.552	197	
	PAGARE 7 USD	1	0	0	1	0	0	1	252.962	252	
	PAGARE 8 USD	1	0	0	1	0	0	1	902.119	976	
	PAGARE 9 USD	1	0	0	1	0	0	1	812.951	809	
	PAGARE 10 USD	1	0	0	1	0	0	1	405.309	403	
	PAGARE 11 USD	1	0	0	1	0	0	1	764.146	760	
	PAGARE 12 USD	1	0	0	1	0	0	1	906.403	901	
	PAGARE 13 USD	1	0	0	1	0	0	1	793.506	789	
	PAGARE 14 USD	1	0	0	1	0	0	1	6.101.921	6.174	
	PAGARE 15 USD	1	0	0	1	0	0	1	263.233	263	
	PAGARE 16 USD	1	0	0	1	0	0	1	657.535	657	
	PAGARE 17 USD	1	0	0	1	0	0	1	255.747	255	
	PAGARE 18 USD	1	0	0	1	0	0	1	79.370	79	
	PAGARE 19 USD	1	0	0	1	0	0	1	97.450	97	
	PAGARE 20 USD	1	0	0	1	0	0	1	305.127	305	
	PAGARE 21 USD	1	0	0	1	0	0	1	119.967	120	
	PAGARE 22 USD	1	0	0	1	0	0	1	101.409	101	
	PAGARE 23 USD	1	0	0	1	0	0	1	125.115	125	
	PAGARE 24 USD	1	0	0	1	0	0	1	511.506	508	
	PAGARE 25 USD	1	0	0	1	0	0	1	717.137	714	
	PAGARE 26 USD	1	0	0	1	0	0	1	279.799	277	
	PAGARE 26 USD	1	0	0	1	0	0	1	610.800	615	

PAGARE 27 USD	1	0	0	1	0	0	1	442.014	439
PAGARE 28 USD	1	0	0	1	0	0	1	590.973	595
PAGARE 29 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.241.964	1.240
PAGARE 30 USD	1	0	0	1	0	0	1	647.320	646
PAGARE 31 USD	1	0	0	1	0	0	1	211.231	211
PAGARE 32 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.916.230	1.914
PAGARE 33 USD	1	0	0	1	0	0	1	126.974	129
PAGARE 34 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.532.634	1.531
PAGARE 35 USD	1	0	0	1	0	0	1	330.693	335
PAGARE 36 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.054.223	1.053
PAGARE 37 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.556.831	1.555
PAGARE 38 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.209.683	1.209
PAGARE 39 USD	1	0	0	1	0	0	1	222.105	221
PAGARE 40 USD	1	0	0	1	0	0	1	119.526	119
PAGARE 41 USD	1	0	0	1	0	0	1	543.764	541
PAGARE 42 USD	1	0	0	1	0	0	1	500.220	500
PAGARE 43 USD	1	0	0	1	0	0	1	231.415	231
PAGARE 44 USD	1	0	0	1	0	0	1	10.011.204	10.757
PAGARE 45 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.780.299	1.779
PAGARE 46 USD	1	0	0	1	0	0	1	102.834	102
PAGARE 47 USD	1	0	0	1	0	0	1	932.824	932
PAGARE 48 USD	1	0	0	1	0	0	1	3.574.790	3.559
PAGARE 49 USD	1	0	0	1	0	0	1	273.300	273
PAGARE 50 USD	1	0	0	1	0	0	1	925.575	925
PAGARE 51 USD	1	0	0	1	0	0	1	604.604	600
PAGARE 52 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.912.979	2.900
PAGARE 53 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.217.694	1.217
PAGARE 54 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.820.952	1.820
PAGARE 55 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.820.951	1.822
PAGARE 56 USD	1	0	0	1	0	0	1	765.921	765
PAGARE 57 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.071.975	1.071
PAGARE 58 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.101.925	2.100
PAGARE 59 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.023.916	2.015
PAGARE 60 USD	1	0	0	1	0	0	1	964.197	964
PAGARE 61 USD	1	0	0	1	0	0	1	452.260	452
PAGARE 62 USD	1	0	0	1	0	0	1	154.000	154
PAGARE 63 USD	1	0	0	1	0	0	1	737.570	737
PAGARE 64 USD	1	0	0	1	0	0	1	0.100.666	0.062
PAGARE 65 USD	1	0	0	1	0	0	1	131.951	131
PAGARE 66 USD	1	0	0	1	0	0	1	200.840	201
PAGARE 67 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.331.977	2.321
PAGARE 68 USD	1	0	0	1	0	0	1	6.112.245	6.001
PAGARE 69 USD	1	0	0	1	0	0	1	3.999.417	3.924
PAGARE 70 USD	1	0	0	1	0	0	1	504.733	502
PAGARE 71 USD	1	0	0	1	0	0	1	407.653	406
PAGARE 72 USD	1	0	0	1	0	0	1	3.024.597	3.011
PAGARE 73 USD	1	0	0	1	0	0	1	311.846	312
PAGARE 74 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.019.302	2.019
PAGARE 75 USD	1	0	0	1	0	0	1	590.116	590
PAGARE 76 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.127.157	1.127
PAGARE 77 USD	1	0	0	1	0	0	1	240.195	240
PAGARE 78 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.772.550	2.772
PAGARE 79 USD	1	0	0	1	0	0	1	646.037	645
PAGARE 80 USD	1	0	0	1	0	0	1	150.330	150
PAGARE 81 USD	1	0	0	1	0	0	1	824.163	821
PAGARE 82 USD	1	0	0	1	0	0	1	355.989	355
PAGARE 83 USD	1	0	0	1	0	0	1	236.662	236
PAGARE 84 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.913.471	2.899
PAGARE 85 USD	1	0	0	1	0	0	1	7.071.721	7.039
PAGARE 86 USD	1	0	0	1	0	0	1	3.973.613	3.957
PAGARE 87 USD	1	0	0	1	0	0	1	835.830	832
PAGARE 88 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.556.091	2.546
PAGARE 89 USD	1	0	0	1	0	0	1	84.733	85
PAGARE 90 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.350.900	2.350
PAGARE 91 USD	1	0	0	1	0	0	1	347.405	347
PAGARE 92 USD	1	0	0	1	0	0	1	305.931	305
PAGARE 93 USD	1	0	0	1	0	0	1	920.483	923
PAGARE 94 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.227.902	1.223
PAGARE 95 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.072.404	1.065
PAGARE 96 USD	1	0	0	1	0	0	1	126.206	126
PAGARE 97 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.192.871	1.187
PAGARE 98 USD	1	0	0	1	0	0	1	4.110.295	4.110
PAGARE 99 USD	1	0	0	1	0	0	1	344.769	345
PAGARE 100 USD	1	0	0	1	0	0	1	564.715	562
PAGARE 101 USD	1	0	0	1	0	0	1	7.525.403	7.496
PAGARE 102 USD	1	0	0	1	0	0	1	361.003	360
PAGARE 103 USD	1	0	0	1	0	0	1	562.242	562
PAGARE 104 USD	1	0	0	1	0	0	1	499.065	499
PAGARE 105 USD	1	0	0	1	0	0	1	173.762	173
PAGARE 106 USD	1	0	0	1	0	0	1	133.690	123
PAGARE 107 USD	1	0	0	1	0	0	1	117.096	117
PAGARE 108 USD	1	0	0	1	0	0	1	164.641	164
PAGARE 109 USD	1	0	0	1	0	0	1	55.530	55

PAGARE 110 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.054.662	1.040			
PAGARE 111 USD	1	0	0	1	0	0	1	201.713	200			
PAGARE 112 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.292.540	1.200			
PAGARE 113 USD	1	0	0	1	0	0	1	157.005	156			
PAGARE 114 USD	1	0	0	1	0	0	1	59.753	60			
PAGARE 115 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.033.097	1.036			
PAGARE 116 USD	1	0	0	1	0	0	1	126.055	126			
PAGARE 117 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.362.104	1.363			
PAGARE 118 USD	1	0	0	1	0	0	1	591.173	591			
PAGARE 119 USD	1	0	0	1	0	0	1	5.500.709	5.492			
PAGARE 120 USD	1	0	0	1	0	0	1	071.622	069			
PAGARE 121 USD	1	0	0	1	0	0	1	615.007	613			
PAGARE 122 USD	1	0	0	1	0	0	1	520.015	527			
PAGARE 123 USD	1	0	0	1	0	0	1	169.016	169			
PAGARE 124 USD	1	0	0	1	0	0	1	131.591	131			
PAGARE 125 USD	1	0	0	1	0	0	1	130.520	130			
PAGARE 126 USD	1	0	0	1	0	0	1	175.927	175			
PAGARE 127 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.091.991	1.099			
PAGARE 128 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.949.213	1.944			
PAGARE 129 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.111.852	1.100			
PAGARE 130 USD	1	0	0	1	0	0	1	122.637	122			
PAGARE 131 USD	1	0	0	1	0	0	1	195.464	196			
PAGARE 132 USD	1	0	0	1	0	0	1	902.040	899			
PAGARE 133 USD	1	0	0	1	0	0	1	6.324.204	6.314			
PAGARE 134 USD	1	0	0	1	0	0	1	7.410.202	7.406			
PAGARE 135 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.240.120	1.230			
PAGARE 136 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.367.200	2.365			
PAGARE 137 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.091.725	1.090			
PAGARE 138 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.021.895	1.019			
PAGARE 139 USD	1	0	0	1	0	0	1	906.573	906			
PAGARE 140 USD	1	0	0	1	0	0	1	856.730	855			
PAGARE 141 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.424.026	1.423			
PAGARE 142 USD	1	0	0	1	0	0	1	3.062.505	3.061			
PAGARE 143 USD	1	0	0	1	0	0	1	3.453.096	3.449			
PAGARE 144 USD	1	0	0	1	0	0	1	3.612.009	3.604			
PAGARE 145 USD	1	0	0	1	0	0	1	757.006	755			
PAGARE 146 USD	1	0	0	1	2.795.165	2.790	1	2.690.030	2.693			
PAGARE 147 USD	1	0	0	1	760.720	760	1	734.204	733			
PAGARE 148 USD	1	0	0	1	1.100.111	1.107	1	1.146.022	1.145			
PAGARE 149 USD	1	0	0	1	7.027.540	7.000	1	6.703.333	6.764			
PAGARE 150 USD	1	0	0	1	4.304.215	4.367	1	4.231.050	4.215			
PAGARE 151 USD	1	0	0	1	503.655	503	1	563.372	563			
PAGARE 152 USD	1	0	0	1	3.196.281	3.192	1	3.005.303	3.001			
PAGARE 153 USD	1	0	0	1	1.252.601	1.251	1	1.209.149	1.200			
PAGARE 154 USD	1	0	0	1	53.512	53	1	51.652	52			
PAGARE 155 USD	1	0	0	1	491.223	491	1	474.153	474			
PAGARE 156 USD	1	0	0	1	2.177.409	2.175	1	2.101.741	2.099			
PAGARE 157 USD	1	0	0	1	0	0	1	631.701	630			
PAGARE 158 USD	1	0	0	1	0	0	1	659.562	659			
PAGARE 159 USD	1	0	0	1	0	0	1	016.500	015			
PAGARE 160 USD	1	0	0	1	0	0	1	534.172	533			
PAGARE 161 USD	1	0	0	1	0	0	1	90.502	90			
PAGARE 162 USD	1	0	0	1	0	0	1	260.190	260			
PAGARE 163 USD	1	0	0	1	0	0	1	009.749	009			
PAGARE 164 USD	1	0	0	1	0	0	1	750.670	750			
PAGARE 165 USD	1	0	0	1	0	0	1	101.502	101			
PAGARE 166 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.047.512	2.044			
PAGARE 167 USD	1	0	0	1	0	0	1	794.100	799			
PAGARE 168 USD	1	0	0	1	0	0	1	9.010.612	9.737			
PAGARE 169 USD	1	0	0	1	0	0	1	196.217	193			
PAGARE 170 USD	1	0	0	1	0	0	1	3.767.719	3.746			
PAGARE 171 USD	1	0	0	1	0	0	1	90.460	90			
PAGARE 172 USD	1	0	0	1	0	0	1	095.774	091			
PAGARE 173 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.903.097	1.902			
PAGARE 174 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.613.002	2.696			
PAGARE 175 USD	1	0	0	1	0	0	1	666.153	662			
PAGARE 176 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.056.761	1.054			
PAGARE 177 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.673.090	2.669			
PAGARE 178 USD	1	0	0	1	0	0	1	9.353.941	9.337			
PAGARE 179 USD	1	0	0	1	0	0	1	4.664.775	4.653			
PAGARE 180 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.959.026	1.954			
PAGARE 181 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.919.160	2.912			
PAGARE 182 USD	1	0	0	1	0	0	1	177.539	177			
PAGARE 183 USD	1	0	0	1	0	0	1	92.470	92			
PAGARE 184 USD	1	1.201.200	1.197	1	0	0	1	1.201.200	1.197			
PAGARE 185 USD	1	002.144	079	1	0	0	1	002.144	079			
PAGARE 186 USD	1	721.292	719	1	0	0	1	721.292	719			
PAGARE 187 USD	1	2.164.132	2.154	1	0	0	1	2.164.132	2.154			
PAGARE 188 USD	1	3.909.062	3.899	1	0	0	1	3.909.062	3.899			
PAGARE 189 USD	1	2.060.343	2.059	1	0	0	1	2.060.343	2.059			
PAGARE 190 USD	1	2.021.525	2.004	1	0	0	1	2.021.525	2.004			
PAGARE 191 USD	1	1.056.322	1.046	1	0	0	1	1.056.322	1.046			
PAGARE 192 USD	1	976.540	972	1	0	0	1	976.540	972			
PAGARE 193 USD	1	1.355.172	1.352	1	0	0	1	1.355.172	1.352			
PAGARE 194 USD	1	993.910	990	1	0	0	1	993.910	990			
PAGARE 195 USD	1	1.753.023	1.747	1	0	0	1	1.753.023	1.747			
Total	0723	195	0724	20.610	1723	156	1724	23.055	2723	100	2724	292.041

CUADRO B

(miles de euros)		Intereses							Principal pendiente		Total Pendiente	Correcciones de valor por reperci6n de perdidas	
Serie	Denominaci6n serie	Grado de subordinaci6n	Indice de referencia	Megan	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses Impagados	Serie de divergencia intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado			
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739
	PAGARE 1 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 2 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 3 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 4 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 5 USD	NS	FIJO	0,00	1,99	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 6 USD	NS	FIJO	0,00	1,99	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 7 USD	NS	FIJO	0,00	1,99	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 8 USD	NS	FIJO	0,00	1,94	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 9 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 10 USD	NS	FIJO	0,00	1,99	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 11 USD	NS	FIJO	0,00	1,99	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 12 USD	NS	FIJO	0,00	1,99	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 13 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 14 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 15 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 16 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 17 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 18 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 19 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 20 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 21 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 22 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 23 USD	NS	FIJO	0,00	1,99	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 24 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 25 USD	NS	FIJO	0,00	1,99	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 26 USD	NS	FIJO	0,00	1,99	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 27 USD	NS	FIJO	0,00	1,99	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 28 USD	NS	FIJO	0,00	1,99	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 29 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 30 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 31 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 32 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 33 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 34 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 35 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 36 USD	NS	FIJO	0,00	1,45	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 37 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 38 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 39 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 40 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	0	NO	0	0	0	0

	PAGARE 91 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 92 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 93 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 94 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 95 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 96 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 97 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 98 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 99 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 100 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 101 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 102 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 103 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 104 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 105 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 106 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 107 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 108 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 109 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 110 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 111 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 112 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 113 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 114 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 115 USD	NG	FUO	0,00	1,66	0	0	NO	0	0	0	0

	PAGARE 116 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 117 USD	NG	FUO	0,00	1,55	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 118 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 119 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 120 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 121 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 122 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 123 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 124 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 125 USD	NG	FUO	0,00	1,29	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 126 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 127 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 128 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 129 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 130 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 131 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 132 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 133 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 134 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 135 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 136 USD	NG	FUO	0,00	1,37	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 137 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 138 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 139 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 140 USD	NG	FUO	0,00	1,42	0	0	NO	0	0	0	0

PAGARE 141 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 142 USD	NG	FUO	0,00	0,91	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 143 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 144 USD	NG	FUO	0,00	1,47	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 145 USD	NG	FUO	0,00	1,47	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 146 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 147 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 148 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 149 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 150 USD	NG	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 151 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 152 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 153 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 154 USD	NG	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 155 USD	NG	FUO	0,00	1,30	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 156 USD	NG	FUO	0,00	1,42	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 157 USD	NG	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 158 USD	NG	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 159 USD	NG	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 160 USD	NG	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 161 USD	NG	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 162 USD	NG	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 163 USD	NG	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 164 USD	NG	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 165 USD	NG	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0

PAGARE 166 USD	NG	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 167 USD	NG	FUO	0,00	1,97	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 168 USD	NG	FUO	0,00	1,90	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 169 USD	NG	FUO	0,00	2,17	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 170 USD	NG	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 171 USD	NG	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 172 USD	NG	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 173 USD	NG	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 174 USD	NG	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 175 USD	NG	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 176 USD	NG	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 177 USD	NG	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 178 USD	NG	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 179 USD	NG	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 180 USD	NG	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 181 USD	NG	FUO	0,00	2,13	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 182 USD	NG	FUO	0,00	2,13	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 183 USD	NG	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 184 USD	NG	FUO	0,00	1,99	3	0	NO	1.197	0	1.200	0
PAGARE 185 USD	NG	FUO	0,00	1,99	2	0	NO	079	0	881	0
PAGARE 186 USD	NG	FUO	0,00	1,99	1	0	NO	719	0	721	0
PAGARE 187 USD	NG	FUO	0,00	1,99	4	0	NO	2.154	0	2.150	0
PAGARE 188 USD	NG	FUO	0,00	1,99	7	0	NO	3.999	0	3.905	0
PAGARE 189 USD	NG	FUO	0,00	1,99	3	0	NO	2.059	0	2.062	0
PAGARE 190 USD	NG	FUO	0,00	1,99	5	0	NO	2.004	0	2.009	0

PAGARE 191 USD	NG	FUO	0,00	1,99	2	0	NO	1.846	0	1.848	0					
PAGARE 192 USD	NG	FUO	0,00	1,99	1	0	NO	972	0	973	0					
PAGARE 193 USD	NG	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	1.352	0	1.352	0					
PAGARE 194 USD	NG	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	990	0	990	0					
PAGARE 195 USD	NG	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	1.747	0	1.747	0					
Total					0740	20	0741	0	0743	20.610	0744	0	0745	20.646	0746	0

	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 19/01/2021			
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	1,99	0740	1,49	0749	1,62

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2023				Situación periodo comparativo anterior 31/12/2022			
Serie	Denominación serie	Amortización principal		Intereses		Amortización principal		Intereses	
		Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753
	PAGARE 1 USD	0	1.406	0	5	0	1.406	0	5
	PAGARE 2 USD	0	1.001	0	4	0	1.001	0	4
	PAGARE 3 USD	0	372	0	1	0	372	0	1
	PAGARE 4 USD	0	422	0	2	0	422	0	2
	PAGARE 5 USD	0	237	0	0	0	237	0	0
	PAGARE 6 USD	0	155	0	1	0	155	0	1
	PAGARE 7 USD	0	930	0	5	0	930	0	5
	PAGARE 8 USD	0	771	0	3	0	771	0	3
	PAGARE 9 USD	0	506	0	2	0	506	0	2
	PAGARE 10 USD	0	925	0	4	0	925	0	4
	PAGARE 11 USD	0	1.097	0	4	0	1.097	0	4
	PAGARE 12 USD	0	960	0	4	0	960	0	4
	PAGARE 13 USD	0	6.472	0	7	0	6.472	0	7
	PAGARE 14 USD	0	276	0	0	0	276	0	0
	PAGARE 15 USD	0	600	0	1	0	600	0	1
	PAGARE 16 USD	0	260	0	0	0	260	0	0
	PAGARE 17 USD	0	83	0	0	0	83	0	0
	PAGARE 18 USD	0	102	0	0	0	102	0	0
	PAGARE 19 USD	0	320	0	0	0	320	0	0
	PAGARE 20 USD	0	126	0	0	0	126	0	0
	PAGARE 21 USD	0	190	0	0	0	190	0	0
	PAGARE 22 USD	0	131	0	0	0	131	0	0
	PAGARE 23 USD	0	524	0	3	0	524	0	3
	PAGARE 24 USD	0	736	0	3	0	736	0	3
	PAGARE 25 USD	0	206	0	1	0	206	0	1
	PAGARE 26 USD	0	635	0	3	0	635	0	3
	PAGARE 27 USD	0	467	0	2	0	467	0	2
	PAGARE 28 USD	0	633	0	3	0	633	0	3
	PAGARE 29 USD	0	1.300	0	2	0	1.300	0	2
	PAGARE 30 USD	0	673	0	1	0	670	0	1
	PAGARE 31 USD	0	221	0	0	0	221	0	0
	PAGARE 32 USD	0	2.006	0	2	0	2.006	0	2
	PAGARE 33 USD	0	135	0	0	0	135	0	0
	PAGARE 34 USD	0	1.605	0	2	0	1.605	0	2
	PAGARE 35 USD	0	355	0	0	0	355	0	0
	PAGARE 36 USD	0	1.104	0	1	0	1.104	0	1
	PAGARE 37 USD	0	1.661	0	2	0	1.661	0	2
	PAGARE 38 USD	0	1.267	0	1	0	1.267	0	1
	PAGARE 39 USD	0	240	0	1	0	240	0	1
	PAGARE 40 USD	0	129	0	0	0	129	0	0
	PAGARE 41 USD	0	506	0	2	0	506	0	2
	PAGARE 42 USD	0	600	0	0	0	600	0	0
	PAGARE 43 USD	0	242	0	0	0	242	0	0
	PAGARE 44 USD	0	11.656	0	47	0	11.656	0	47
	PAGARE 45 USD	0	1.065	0	1	0	1.065	0	1
	PAGARE 46 USD	0	197	0	1	0	197	0	1
	PAGARE 47 USD	0	977	0	1	0	977	0	1
	PAGARE 48 USD	0	3.056	0	14	0	3.056	0	14
	PAGARE 49 USD	0	206	0	0	0	206	0	0
	PAGARE 50 USD	0	970	0	1	0	970	0	1
	PAGARE 51 USD	0	752	0	4	0	752	0	4
	PAGARE 52 USD	0	3.142	0	11	0	3.142	0	11
	PAGARE 53 USD	0	1.276	0	1	0	1.276	0	1
	PAGARE 54 USD	0	1.971	0	1	0	1.971	0	1
	PAGARE 55 USD	0	1.974	0	7	0	1.974	0	7
	PAGARE 56 USD	0	502	0	1	0	502	0	1
	PAGARE 57 USD	0	1.123	0	1	0	1.123	0	1
	PAGARE 58 USD	0	2.202	0	1	0	2.202	0	1
	PAGARE 59 USD	0	2.103	0	0	0	2.103	0	0
	PAGARE 60 USD	0	1.010	0	1	0	1.010	0	1
	PAGARE 61 USD	0	466	0	1	0	466	0	1
	PAGARE 62 USD	0	161	0	0	0	161	0	0
	PAGARE 63 USD	0	773	0	0	0	773	0	0
	PAGARE 64 USD	0	0.900	0	42	0	0.900	0	42
	PAGARE 65 USD	0	145	0	1	0	145	0	1
	PAGARE 66 USD	0	210	0	0	0	210	0	0
	PAGARE 67 USD	0	2.433	0	1	0	2.433	0	1

PAGARE 60 USD	0	6.719	0	20	0	6.719	0	20
PAGARE 69 USD	0	3.003	0	14	0	3.003	0	14
PAGARE 70 USD	0	631	0	2	0	631	0	2
PAGARE 71 USD	0	526	0	2	0	526	0	2
PAGARE 72 USD	0	3.263	0	12	0	3.263	0	12
PAGARE 73 USD	0	327	0	0	0	327	0	0
PAGARE 74 USD	0	2.116	0	1	0	2.116	0	1
PAGARE 75 USD	0	610	0	0	0	610	0	0
PAGARE 76 USD	0	1.101	0	0	0	1.101	0	0
PAGARE 77 USD	0	252	0	0	0	252	0	0
PAGARE 78 USD	0	2.906	0	1	0	2.906	0	1
PAGARE 79 USD	0	677	0	1	0	677	0	1
PAGARE 80 USD	0	155	0	0	0	155	0	0
PAGARE 81 USD	0	509	0	3	0	509	0	3
PAGARE 82 USD	0	304	0	1	0	304	0	1
PAGARE 83 USD	0	255	0	1	0	255	0	1
PAGARE 84 USD	0	3.203	0	13	0	3.203	0	13
PAGARE 85 USD	0	0.494	0	29	0	0.494	0	29
PAGARE 86 USD	0	4.200	0	15	0	4.200	0	15
PAGARE 87 USD	0	902	0	3	0	902	0	3
PAGARE 88 USD	0	2.759	0	10	0	2.759	0	10
PAGARE 89 USD	0	09	0	0	0	09	0	0
PAGARE 90 USD	0	2.472	0	1	0	2.472	0	1
PAGARE 91 USD	0	350	0	0	0	350	0	0
PAGARE 92 USD	0	330	0	1	0	330	0	1
PAGARE 93 USD	0	1.020	0	5	0	1.020	0	5
PAGARE 94 USD	0	1.325	0	5	0	1.325	0	5
PAGARE 95 USD	0	2.021	0	7	0	2.021	0	7
PAGARE 96 USD	0	136	0	0	0	136	0	0
PAGARE 97 USD	0	1.311	0	6	0	1.311	0	6
PAGARE 98 USD	0	4.309	0	0	0	4.309	0	0
PAGARE 99 USD	0	361	0	0	0	361	0	0
PAGARE 100 USD	0	621	0	3	0	621	0	3
PAGARE 101 USD	0	0.122	0	26	0	0.122	0	26
PAGARE 102 USD	0	390	0	1	0	390	0	1
PAGARE 103 USD	0	509	0	0	0	509	0	0
PAGARE 104 USD	0	514	0	0	0	514	0	0
PAGARE 105 USD	0	191	0	1	0	191	0	1
PAGARE 106 USD	0	134	0	0	0	134	0	0
PAGARE 107 USD	0	126	0	0	0	126	0	0
PAGARE 108 USD	0	170	0	1	0	170	0	1
PAGARE 109 USD	0	57	0	0	0	57	0	0
PAGARE 110 USD	0	2.002	0	6	0	2.002	0	6
PAGARE 111 USD	0	310	0	1	0	310	0	1
PAGARE 112 USD	0	1.396	0	4	0	1.396	0	4
PAGARE 113 USD	0	173	0	1	0	173	0	1
PAGARE 114 USD	0	65	0	0	0	65	0	0
PAGARE 115 USD	0	1.979	0	6	0	1.979	0	6
PAGARE 116 USD	0	140	0	0	0	140	0	0
PAGARE 117 USD	0	1.477	0	4	0	1.477	0	4
PAGARE 118 USD	0	609	0	0	0	609	0	0
PAGARE 119 USD	0	5.950	0	15	0	5.950	0	15
PAGARE 120 USD	0	942	0	2	0	942	0	2
PAGARE 121 USD	0	664	0	2	0	664	0	2
PAGARE 122 USD	0	571	0	1	0	571	0	1
PAGARE 123 USD	0	103	0	0	0	103	0	0
PAGARE 124 USD	0	145	0	1	0	145	0	1
PAGARE 125 USD	0	143	0	0	0	143	0	0
PAGARE 126 USD	0	194	0	1	0	194	0	1
PAGARE 127 USD	0	1.100	0	2	0	1.100	0	2
PAGARE 128 USD	0	2.107	0	4	0	2.107	0	4
PAGARE 129 USD	0	1.224	0	3	0	1.224	0	3
PAGARE 130 USD	0	133	0	0	0	133	0	0
PAGARE 131 USD	0	212	0	0	0	212	0	0
PAGARE 132 USD	0	1.002	0	4	1.002	1.002	4	4
PAGARE 133 USD	0	6.041	0	9	0	6.041	0	9
PAGARE 134 USD	0	0.025	0	11	0	0.025	0	11
PAGARE 135 USD	0	1.360	0	2	0	1.360	0	2
PAGARE 136 USD	0	2.563	0	2	0	2.563	0	2
PAGARE 137 USD	0	1.101	0	1	0	1.101	0	1
PAGARE 138 USD	0	1.971	0	2	0	1.971	0	2
PAGARE 139 USD	0	901	0	1	0	901	0	1
PAGARE 140 USD	0	1.065	0	1	1.065	1.065	1	1
PAGARE 141 USD	0	1.506	0	1	1.506	1.506	1	1
PAGARE 142 USD	0	4.303	0	2	4.303	4.303	2	2
PAGARE 143 USD	0	3.045	0	3	3.045	3.045	3	3
PAGARE 144 USD	0	3.030	0	7	3.030	3.030	7	7
PAGARE 145 USD	0	804	0	2	804	804	2	2
PAGARE 146 USD	0	2.747	0	4	0	0	0	0
PAGARE 147 USD	0	740	0	1	0	0	0	0
PAGARE 148 USD	0	1.160	0	1	0	0	0	0
PAGARE 149 USD	0	7.039	0	16	0	0	0	0
PAGARE 150 USD	0	4.203	0	14	0	0	0	0
PAGARE 151 USD	0	574	0	1	0	0	0	0

PAGARE 152 USD	0	3.143	0	3	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 153 USD	0	1.232	0	1	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 154 USD	0	53	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 155 USD	0	403	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 156 USD	0	2.141	0	2	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 157 USD	0	652	0	1	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 158 USD	0	663	0	1	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 159 USD	0	843	0	1	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 160 USD	0	551	0	1	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 161 USD	0	102	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 162 USD	0	269	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 163 USD	0	919	0	1	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 164 USD	0	763	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 165 USD	0	107	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 166 USD	0	2.114	0	3	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 167 USD	709	709	4	4	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 168 USD	9.737	9.737	60	60	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 169 USD	195	195	1	1	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 170 USD	3.746	3.746	10	10	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 171 USD	90	90	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 172 USD	891	891	4	4	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 173 USD	1.092	1.092	9	9	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 174 USD	2.096	2.096	15	15	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 175 USD	662	662	4	4	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 176 USD	1.054	1.054	2	2	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 177 USD	2.669	2.669	4	4	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 178 USD	9.337	9.337	14	14	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 179 USD	4.653	4.653	10	10	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 180 USD	1.954	1.954	5	5	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 181 USD	2.912	2.912	6	6	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 182 USD	177	177	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 183 USD	92	92	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 184 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 185 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 186 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 187 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 188 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 189 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 190 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 191 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 192 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 193 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 194 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0						
PAGARE 195 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0						
Total	0754	43.754	0755	207.065	0756	154	0757	723	1754	16.442	1755	212.630	1756	20	1757	\$15

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (en miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 19/01/2021			
inferior a 1 año	0765	20.610	23.855	292.041		
Entre 1 y 2 años	0766	1766	1766	2766		
Entre 2 y 3 años	0767	1767	1767	2767		
Entre 3 y 4 años	0768	1768	1768	2768		
Entre 4 y 5 años	0769	1769	1769	2769		
Entre 5 y 10 años	0770	1770	1770	2770		
Superior a 10 años	0771	1771	1771	2771		
Total	0772	20.610	23.855	292.041		
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,14	1773	0,11	2773	0,19



Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT

5,05,3

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT
Denominación del compartimento: 202100002
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mayores crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 19/01/2021
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	1775	2775
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	1776	2776
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	1777	2777
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	1778	2778
1.4 Rating de la contrapartida	0779	1779	2779
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	1780	2780
2 Importe disponible de la línea 1 de liquidez (miles de euros)	0781	1781	2781
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	1782	2782
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	1783	2783
2.3 Rating de la contrapartida	0784	1784	2784
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785	1785	2785
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	1786	2786
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	1787	2787
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	1788	2788
3.3 Rating del avalista	0789	1789	2789
3.4 Rating requerido del avalista	0790	1790	2790
4 Subordinación de series (CPI)	0791	1791	2791
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	1792	2792
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793	1793	2793
5.1 Denominación de la contrapartida	0794	1794	2794
5.2 Rating de la contrapartida	0795	1795	2795
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796	1796	2796

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)			Valor en libros (miles de euros)			Otras características
	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 19/01/2021	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 19/01/2021	
Préstamos hipotecarios	0011	1011	2011	0029	1029	2029	3029
Cédulas hipotecarias	0012	1012	2012	0030	1030	2030	3030
Préstamos a promotores	0013	1013	2013	0031	1031	2031	3031
Préstamos a PYMES	0014	1014	2014	0032	1032	2032	3032
Préstamos a empresas	0015	1015	2015	0033	1033	2033	3033
Préstamos corporativos	0016	1016	2016	0034	1034	2034	3034
Cédulas territoriales	0017	1017	2017	0035	1035	2035	3035
Bonos de tesorería	0018	1018	2018	0036	1036	2036	3036
Deuda subordinada	0019	1019	2019	0037	1037	2037	3037
Creditos AAPP	0020	1020	2020	0038	1038	2038	3038
Préstamos consumo	0021	1021	2021	0039	1039	2039	3039
Préstamos suamoción	0022	1022	2022	0040	1040	2040	3040
Cuentas de arrendamiento financiero (leasing)	0023	1023	2023	0041	1041	2041	3041
Cuentas a cobrar	0024	1024	2024	0042	1042	2042	3042
Derechos de crédito futuros	0025	1025	2025	0043	1043	2043	3043
Bonos de titulización	0026	1026	2026	0044	1044	2044	3044
Total	0027	1027	2027	0045	1045	2045	3045



Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT

5.05.4

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT

Denominación del compartimento: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago	Días impago	Importe impago acumulado		Ratio			Ref. Folleto						
			Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Última Fecha Pago							
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	7002	360	7003	0	7006	0	7009	0,00	7012	0,00	7015	0,00	
2. Activos Morosos por otras razones				7004	7007			7010		7013		7016		
Total Morosos				7005	7008			7011		7014		7017		7018
														ESCRITURA DE CONSTRUCCION ANEXO 1
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	7020		7021	7024			7027		7030		7033		
4. Activos Fallidos por otras razones				7022	7025			7028		7031		7034		
Total Fallidos				7023	7026			7029		7032		7035		7036

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto
	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Última Fecha Pago	
0050		1050		2050
0051		1051		2051
0052		1052		2052
0053		1053		2053

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización sucesional: series	0054	0050	1050	2050
Diferimiento/postergamiento dividendos: series	0055	0059	1059	2059
No Reducción del Fondo de Reserva	0056	0060	1060	2060
OTROS TRIGGERS	0057	0061	1061	2061

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



Determinada diferencia entre cobros y pagos (milés de euros)		Fecha cálculo										Total	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0005												
Saldo inicial	0006												
Cobros del periodo	0007												
Pagos por gastos y comisiones distintas de la comisión variable	0008												
Pagos por derivados	0009												
Retención importe Fondo de Reserva	0090												
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0091												
Pagos por deudas con entidades de crédito	0092												
Recto pagos/retenciones	0093												
Saldo disponible	0094												
Liquidación de comisión variable	0095												



Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

	S.06
Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT	
Denominación del compartimento: 202100002	
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2023	

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

INFORME SOBRE EL CUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE RIESGOS



Notas Explicativas

El fondo no mantiene activos disponibles para la venta ni cobertura de flujos de efectivo, por tanto, no hay para cumplimentar en el S.04

Estos estados corresponden al compartimento del Fondo que está denominado en dólares. Para realizar la conversión a euros se ha utilizado el tipo de cambio euro / dólar del último día hábil de cada mes.

En S01:

La casilla 0157, denominada "otros", incluye las partidas:

- Registro Mercantil: 30€
- CNMV: -208€.
- EBN Banco: 5.252€
- Comisiones bancarias distintas EBN: 524€
- AEAT: -37.200€.

ALPHA AGREGADO



Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT		5.05.1
Denominación del compartimento:		
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT		
Estados agregados: SI		
Fecha: 31/12/2023		
Entidades cedentes de los activos titulizados: ZEPA FINANCE, S.L.		

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Hipótesis iniciales folleto/escritura			
	Tasa de activos dudosos	Tasa de fallo	Tasa de recuperación fallidos	Tasa de amortización anticipada	Tasa de activos dudosos	Tasa de fallo	Tasa de recuperación fallidos	Tasa de amortización anticipada	Tasa de activos dudosos	Tasa de fallo	Tasa de recuperación fallidos	Tasa de amortización anticipada
Participaciones hipotecarias	0320	0400	0420	0440	1320	1400	1420	1440	2320	2400	2420	2440
Certificados de transmisión de hipoteca	0321	0401	0421	0441	1321	1401	1421	1441	2321	2401	2421	2441
Prestamos hipotecarios	0322	0402	0422	0442	1322	1402	1422	1442	2322	2402	2422	2442
Cédulas hipotecarias	0323	0403	0423	0443	1323	1403	1423	1443	2323	2403	2423	2443
Prestamos a promotores	0324	0404	0424	0444	1324	1404	1424	1444	2324	2404	2424	2444
Prestamos a PYMES	0325	0405	0425	0445	1325	1405	1425	1445	2325	2405	2425	2445
Prestamos a empresas	0326	0406	0426	0446	1326	1406	1426	1446	2326	2406	2426	2446
Prestamos corporativos	0327	0407	0427	0447	1327	1407	1427	1447	2327	2407	2427	2447
Cédulas territoriales	0328	0408	0428	0448	1328	1408	1428	1448	2328	2408	2428	2448
Bonos de tesorería	0329	0409	0429	0449	1329	1409	1429	1449	2329	2409	2429	2449
Deuda subordinada	0390	0410	0430	0450	1390	1410	1430	1450	2390	2410	2430	2450
Creditos AAFP	0391	0411	0431	0451	1391	1411	1431	1451	2391	2411	2431	2451
Prestamos consumo	0392	0412	0432	0452	1392	1412	1432	1452	2392	2412	2432	2452
Prestamos automoción	0393	0413	0433	0453	1393	1413	1433	1453	2393	2413	2433	2453
Costas de arrendamiento financiero (leasing)	0394	0414	0434	0454	1394	1414	1434	1454	2394	2414	2434	2454
Cuentas a cobrar	0395	0415	0435	0455	1395	1415	1435	1455	2395	2415	2435	2455
Derechos de crédito futuro	0396	0416	0436	0456	1396	1416	1436	1456	2396	2416	2436	2456
Bonos de titulización	0397	0417	0437	0457	1397	1417	1437	1457	2397	2417	2437	2457
Cédulas internacionalización	0398	0418	0438	0458	1398	1418	1438	1458	2398	2418	2438	2458
Otros	0399	0419	0439	0459	1399	1419	1439	1459	2399	2419	2439	2459

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos	Importe impagado				Principal pendiente no vencido	Otros importes	Deuda Total	
		Principal pendiente vencido	Intereses devengados en contabilidad	Intereses interrumpidos en contabilidad	Total				
Hasta 1 mes	0460	0467	0474	0	0481	0	0488	0502	0509
De 1 a 2 meses	0461	0468	0475	0	0482	0	0489	0503	0510
De 3 a 6 meses	0462	0469	0476	0	0483	0	0490	0504	0511
De 6 a 9 meses	0463	0470	0477	0	0484	0	0491	0505	0512
De 9 a 12 meses	0464	0471	0478	0	0485	0	0492	0506	0513
Más de 12 meses	0465	0472	0479	0	0486	0	0493	0507	0514
Total	0466	0473	0480	0	0487	0	0494	0501	0515

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos	Importe impagado				Principal pendiente no vencido	Otros importes	Deuda Total	Valor garantía	Valor Garantía con Tasación > 2 años	% Deuda / v. Tasación
		Principal pendiente vencido	Intereses devengados en contabilidad	Intereses interrumpidos en contabilidad	Total						
Hasta 1 mes	0515	0522	0529	0536	0543	0550	0557	0564	0571	0578	
De 1 a 3 meses	0516	0523	0530	0537	0544	0551	0558	0565	0572	0579	
De 3 a 6 meses	0517	0524	0531	0538	0545	0552	0559	0566	0573	0580	
De 6 a 9 meses	0518	0525	0532	0539	0546	0553	0560	0567	0574	0581	
De 9 a 12 meses	0519	0526	0533	0540	0547	0554	0561	0568	0575	0582	
Más de 12 meses	0520	0527	0534	0541	0548	0555	0562	0569	0576	0583	
Total	0521	0528	0535	0542	0549	0556	0563	0570	0577	0584	

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente			
	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 19/01/2021	
Inferior a 1 año	0600	21.142	1600	30.000
Entre 1 y 2 años	0601	0	1601	0
Entre 2 y 3 años	0602	0	1602	0
Entre 3 y 4 años	0603	0	1603	0
Entre 4 y 5 años	0604	0	1604	0
Entre 5 y 10 años	0605	0	1605	0
Superior a 10 años	0606	0	1606	0
Total	0607	21.142	1607	30.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	0,14	1608	0,11

Antigüedad	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 19/01/2021
Antigüedad media ponderada (años)	0609	0,10	1609
		0,09	2609
			0,06

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantizado (miles de euros)	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 19/01/2021	
	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente
	0% - 40%	0620	0630	1620	1630	2620
40% - 60%	0621	0631	1621	1631	2621	2631
60% - 80%	0622	0632	1622	1632	2622	2632
80% - 100%	0623	0633	1623	1633	2623	2633
100% - 120%	0624	0634	1624	1634	2624	2634
120% - 140%	0625	0635	1625	1635	2625	2635
140% - 160%	0626	0636	1626	1636	2626	2636
superior al 160%	0627	0637	1627	1637	2627	2637
Total	0628	0638	1628	1638	2628	2638
Media ponderada (%)	0639	0649	1639	1649	2639	2649

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 19/01/2021	
	Tipos de interés medio ponderado	Tipos de interés nominal máximo	Tipos de interés nominal mínimo	Tipos de interés medio ponderado	Tipos de interés nominal máximo	Tipos de interés nominal mínimo
Tipos de interés medio ponderado	0650	3,49	1650	3,00	2650	3,09
Tipos de interés nominal máximo	0651	3,50	1651	3,00	2651	3,50
Tipos de interés nominal mínimo	0652	3,00	1652	3,00	2652	3,00

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 19/01/2021	
	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente
	Andalucía	0660	0	0660	0	2660
Aragón	0661	0	0661	0	2661	0
Asturias	0662	0	0662	0	2662	0
Baleares	0663	0	0663	0	2663	0
Canarias	0664	0	0664	0	2664	0
Cantabria	0665	0	0665	0	2665	0
Castilla-L León	0666	0	0666	0	2666	0
Castilla-La Mancha	0667	0	0667	0	2667	0
Cataluña	0668	0	0668	0	2668	0
Ciudad Real	0669	0	0669	0	2669	0
Ciudad de Ceuta	0670	0	0670	0	2670	0
Extremadura	0671	0	0671	0	2671	0
Galicia	0672	32	0695	21.142	1672	51
Madrid	0673	0	0696	0	1673	0
Málaga	0674	0	0697	0	1674	0
Murcia	0675	0	0698	0	1675	0
Navarra	0676	0	0699	0	1676	0
La Rioja	0677	0	0700	0	1677	0
Comunidad Valenciana	0678	0	0701	0	1678	0
Pais Vasco	0679	32	0702	21.142	1679	51
Total España	0680	0	0703	0	1680	0
Otros países Unión Europea	0681	0	0704	0	1681	0
Resto	0682	0	0705	0	1682	0
Total general	0683	32	0706	21.142	1683	51

Concentración	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 19/01/2021	
	Porcentaje	CNAE	Porcentaje	CNAE	Porcentaje	CNAE
	Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	100,00	1710	100,00	2710
Sector	0711	72,45	1711	20,46	2711	76,67



Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT	5.05.2
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT	
Estados agregados: SI	
Período de la declaración: 31/12/2023	
Mercados de cotización de los valores emitidos:	

INFORMACIÓN RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

Serie	Denominación serie	Situación actual 31/12/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 19/01/2021		
		Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722
	PAGARE 1 EUR	1	0	0	1	0	0	1	925.722	923
	PAGARE 2 EUR	1	0	0	1	0	0	1	633.164	630
	PAGARE 3 EUR	1	0	0	1	0	0	1	132.304	132
	PAGARE 4 EUR	1	0	0	1	0	0	1	59.533	59
	PAGARE 5 EUR	1	0	0	1	0	0	1	567.760	565
	PAGARE 6 EUR	1	0	0	1	0	0	1	402.139	400
	PAGARE 7 EUR	1	0	0	1	0	0	1	230.375	229
	PAGARE 8 EUR	1	0	0	1	0	0	1	4.474.043	4.440
	PAGARE 9 EUR	1	0	0	1	0	0	1	2.382.457	2.365
	PAGARE 10 EUR	1	0	0	1	0	0	1	671.134	660
	PAGARE 11 EUR	1	0	0	1	0	0	1	299.762	300
	PAGARE 12 EUR	1	0	0	1	0	0	1	164.306	164
	PAGARE 13 EUR	1	0	0	1	0	0	1	193.284	193
	PAGARE 14 EUR	1	0	0	1	0	0	1	811.550	811
	PAGARE 15 EUR	1	0	0	1	0	0	1	44.006	44
	PAGARE 16 EUR	1	0	0	1	0	0	1	432.952	432
	PAGARE 17 EUR	1	0	0	1	0	0	1	438.011	439
	PAGARE 18 EUR	1	0	0	1	0	0	1	147.006	147
	PAGARE 19 EUR	1	0	0	1	0	0	1	810.810	810
	PAGARE 20 EUR	1	0	0	1	0	0	1	264.523	264
	PAGARE 21 EUR	1	0	0	1	0	0	1	200.509	200
	PAGARE 22 EUR	1	0	0	1	0	0	1	247.176	247
	PAGARE 23 EUR	1	0	0	1	0	0	1	2.236.612	2.235
	PAGARE 24 EUR	1	0	0	1	0	0	1	33.590	34
	PAGARE 25 EUR	1	0	0	1	0	0	1	37.741	30
	PAGARE 26 EUR	1	0	0	1	0	0	1	215.564	215

PAGARE 27 EUR	1	0	0	1	0	0	1	113.953	113
PAGARE 28 EUR	1	0	0	1	0	0	1	245.274	244
PAGARE 29 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.030.085	1.021
PAGARE 30 EUR	1	0	0	1	0	0	1	264.571	263
PAGARE 31 EUR	1	0	0	1	0	0	1	591.753	589
PAGARE 32 EUR	1	0	0	1	0	0	1	119.245	119
PAGARE 33 EUR	1	0	0	1	0	0	1	107.079	107
PAGARE 34 EUR	1	0	0	1	0	0	1	90.617	90
PAGARE 35 EUR	1	0	0	1	0	0	1	720.163	725
PAGARE 36 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.558.437	1.553
PAGARE 37 EUR	1	0	0	1	0	0	1	407.535	407
PAGARE 38 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.962.533	1.954
PAGARE 39 EUR	1	0	0	1	0	0	1	247.034	247
PAGARE 40 EUR	1	0	0	1	0	0	1	200.303	203
PAGARE 41 EUR	1	0	0	1	0	0	1	36.140	36
PAGARE 42 EUR	1	0	0	1	0	0	1	296.901	296
PAGARE 43 EUR	1	0	0	1	0	0	1	285.546	287
PAGARE 44 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.073.620	1.069
PAGARE 45 EUR	1	0	0	1	0	0	1	330.922	331
PAGARE 46 EUR	1	0	0	1	0	0	1	102.114	102
PAGARE 47 EUR	1	0	0	1	0	0	1	136.756	137
PAGARE 48 EUR	1	0	0	1	0	0	1	214.093	213
PAGARE 49 EUR	1	0	0	1	0	0	1	593.597	591
PAGARE 50 EUR	1	0	0	1	0	0	1	819.260	818
PAGARE 51 EUR	1	0	0	1	0	0	1	204.226	203
PAGARE 52 EUR	1	0	0	1	0	0	1	754.131	751
PAGARE 53 EUR	1	0	0	1	0	0	1	204.050	204
PAGARE 54 EUR	1	0	0	1	0	0	1	366.318	365
PAGARE 55 EUR	1	0	0	1	0	0	1	945.262	941
PAGARE 56 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.203.216	1.279
PAGARE 57 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.226.112	1.222
PAGARE 58 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.072.330	1.072
PAGARE 59 EUR	1	0	0	1	0	0	1	919.375	916
PAGARE 60 EUR	1	0	0	1	0	0	1	16.564.99	16.505
PAGARE 61 EUR	1	0	0	1	0	0	1	8.272.531	8.240
PAGARE 62 EUR	1	0	0	1	0	0	1	12.502.40	12.457
PAGARE 63 EUR	1	0	0	1	0	0	1	2.373.444	2.366
PAGARE 64 EUR	1	0	0	1	0	0	1	716.711	715
PAGARE 65 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.930.935	1.927
PAGARE 66 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.315.303	1.314
PAGARE 67 EUR	1	0	0	1	0	0	1	19.215.19	19.198
PAGARE 68 EUR	1	0	0	1	0	0	1	1.520.014	1.519
PAGARE 69 EUR	1	0	0	1	0	0	1	997.443	993
PAGARE 70 EUR	1	0	0	1	0	0	1	622.710	619
PAGARE 71 EUR	1	0	0	1	1.042.567	1.040	1	1.042.567	1.040
PAGARE 72 EUR	1	0	0	1	380.513	300	1	300.513	300
PAGARE 73 EUR	1	0	0	1	4.731.543	4.725	1	4.731.543	4.725
PAGARE 74 EUR	1	0	0	0	0	0	1	420.802	419
PAGARE 75 EUR	1	0	0	0	0	0	1	67.121	67
PAGARE 76 EUR	1	0	0	0	0	0	1	04.978	85
PAGARE 77 EUR	1	0	0	0	0	0	1	1.001.000	1.070
PAGARE 78 EUR	1	0	0	0	0	0	1	9.326.160	9.003
PAGARE 79 EUR	1	0	0	0	0	0	1	409.704	489
PAGARE 80 EUR	1	0	0	0	0	0	1	340.010	340
PAGARE 81 EUR	1	0	0	0	0	0	1	536.705	536
PAGARE 82 EUR	1	0	0	0	0	0	1	4.911.674	4.902
PAGARE 83 EUR	1	0	0	0	0	0	1	499.030	490
PAGARE 84 EUR	1	12.105	12	0	0	0	1	12.105	12
PAGARE 85 EUR	1	199.355	199	0	0	0	1	199.355	199
PAGARE 86 EUR	1	146.403	146	0	0	0	1	146.403	146
PAGARE 87 EUR	1	167.522	167	0	0	0	1	167.522	167
PAGARE 1 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.597.177	1.590
PAGARE 2 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.161.100	1.156
PAGARE 3 USD	1	0	0	1	0	0	1	399.326	390
PAGARE 4 USD	1	0	0	1	0	0	1	454.056	452
PAGARE 5 USD	1	0	0	1	0	0	1	190.552	197
PAGARE 6 USD	1	0	0	1	0	0	1	252.902	252
PAGARE 7 USD	1	0	0	1	0	0	1	902.119	976
PAGARE 8 USD	1	0	0	1	0	0	1	812.951	800
PAGARE 9 USD	1	0	0	1	0	0	1	405.309	403
PAGARE 10 USD	1	0	0	1	0	0	1	764.146	760
PAGARE 11 USD	1	0	0	1	0	0	1	906.403	901
PAGARE 12 USD	1	0	0	1	0	0	1	793.506	789
PAGARE 13 USD	1	0	0	1	0	0	1	6.101.921	6.174
PAGARE 14 USD	1	0	0	1	0	0	1	263.233	263
PAGARE 15 USD	1	0	0	1	0	0	1	657.535	657
PAGARE 16 USD	1	0	0	1	0	0	1	255.747	255
PAGARE 17 USD	1	0	0	1	0	0	1	79.370	79
PAGARE 18 USD	1	0	0	1	0	0	1	97.450	97
PAGARE 19 USD	1	0	0	1	0	0	1	205.127	305
PAGARE 20 USD	1	0	0	1	0	0	1	119.967	120

PAGARE 21 USD	1	0	0	1	0	0	1	181.489	181
PAGARE 22 USD	1	0	0	1	0	0	1	125.115	125
PAGARE 23 USD	1	0	0	1	0	0	1	511.506	508
PAGARE 24 USD	1	0	0	1	0	0	1	717.137	714
PAGARE 25 USD	1	0	0	1	0	0	1	278.799	277
PAGARE 26 USD	1	0	0	1	0	0	1	618.800	615
PAGARE 27 USD	1	0	0	1	0	0	1	442.014	439
PAGARE 28 USD	1	0	0	1	0	0	1	595.973	593
PAGARE 29 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.241.964	1.240
PAGARE 30 USD	1	0	0	1	0	0	1	647.320	646
PAGARE 31 USD	1	0	0	1	0	0	1	211.231	211
PAGARE 32 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.916.230	1.914
PAGARE 33 USD	1	0	0	1	0	0	1	128.974	128
PAGARE 34 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.532.634	1.531
PAGARE 35 USD	1	0	0	1	0	0	1	335.693	335
PAGARE 36 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.054.223	1.053
PAGARE 37 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.506.031	1.505
PAGARE 38 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.209.903	1.209
PAGARE 39 USD	1	0	0	1	0	0	1	222.105	221
PAGARE 40 USD	1	0	0	1	0	0	1	119.526	119
PAGARE 41 USD	1	0	0	1	0	0	1	543.764	541
PAGARE 42 USD	1	0	0	1	0	0	1	500.225	500
PAGARE 43 USD	1	0	0	1	0	0	1	231.415	231
PAGARE 44 USD	1	0	0	1	0	0	1	10.011.204	10.757
PAGARE 45 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.780.299	1.779
PAGARE 46 USD	1	0	0	1	0	0	1	182.834	182
PAGARE 47 USD	1	0	0	1	0	0	1	932.824	932
PAGARE 48 USD	1	0	0	1	0	0	1	3.574.790	3.559
PAGARE 49 USD	1	0	0	1	0	0	1	273.300	273
PAGARE 50 USD	1	0	0	1	0	0	1	925.575	925
PAGARE 51 USD	1	0	0	1	0	0	1	604.604	600
PAGARE 52 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.912.979	2.900
PAGARE 53 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.217.094	1.217
PAGARE 54 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.000.952	1.000
PAGARE 55 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.029.951	1.022
PAGARE 56 USD	1	0	0	1	0	0	1	765.021	765
PAGARE 57 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.071.975	1.071
PAGARE 58 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.101.925	2.100
PAGARE 59 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.023.016	2.015
PAGARE 60 USD	1	0	0	1	0	0	1	964.197	964
PAGARE 61 USD	1	0	0	1	0	0	1	452.260	452
PAGARE 62 USD	1	0	0	1	0	0	1	154.000	154
PAGARE 63 USD	1	0	0	1	0	0	1	737.570	737
PAGARE 64 USD	1	0	0	1	0	0	1	8.100.666	8.062
PAGARE 65 USD	1	0	0	1	0	0	1	131.951	131
PAGARE 66 USD	1	0	0	1	0	0	1	200.040	201
PAGARE 67 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.321.977	2.321
PAGARE 68 USD	1	0	0	1	0	0	1	6.112.245	6.081
PAGARE 69 USD	1	0	0	1	0	0	1	3.599.417	3.584
PAGARE 70 USD	1	0	0	1	0	0	1	584.733	582
PAGARE 71 USD	1	0	0	1	0	0	1	407.653	406
PAGARE 72 USD	1	0	0	1	0	0	1	3.024.597	3.011
PAGARE 73 USD	1	0	0	1	0	0	1	311.046	312
PAGARE 74 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.019.302	2.019
PAGARE 75 USD	1	0	0	1	0	0	1	590.116	590
PAGARE 76 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.127.157	1.127
PAGARE 77 USD	1	0	0	1	0	0	1	240.195	240
PAGARE 78 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.772.550	2.772
PAGARE 79 USD	1	0	0	1	0	0	1	646.037	645
PAGARE 80 USD	1	0	0	1	0	0	1	150.330	150
PAGARE 81 USD	1	0	0	1	0	0	1	924.163	921
PAGARE 82 USD	1	0	0	1	0	0	1	355.909	355
PAGARE 83 USD	1	0	0	1	0	0	1	236.663	236
PAGARE 84 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.913.471	2.899
PAGARE 85 USD	1	0	0	1	0	0	1	7.871.721	7.839
PAGARE 86 USD	1	0	0	1	0	0	1	3.973.613	3.957
PAGARE 87 USD	1	0	0	1	0	0	1	835.030	832
PAGARE 88 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.556.091	2.546
PAGARE 89 USD	1	0	0	1	0	0	1	84.733	85
PAGARE 90 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.350.880	2.350
PAGARE 91 USD	1	0	0	1	0	0	1	247.485	247
PAGARE 92 USD	1	0	0	1	0	0	1	305.931	305
PAGARE 93 USD	1	0	0	1	0	0	1	928.488	923
PAGARE 94 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.227.982	1.223
PAGARE 95 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.872.484	1.865
PAGARE 96 USD	1	0	0	1	0	0	1	126.206	126
PAGARE 97 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.192.871	1.187
PAGARE 98 USD	1	0	0	1	0	0	1	4.110.295	4.110
PAGARE 99 USD	1	0	0	1	0	0	1	344.769	345
PAGARE 100 USD	1	0	0	1	0	0	1	564.715	562
PAGARE 101 USD	1	0	0	1	0	0	1	7.525.403	7.496
PAGARE 102 USD	1	0	0	1	0	0	1	361.003	360
PAGARE 103 USD	1	0	0	1	0	0	1	562.242	562

PAGARE 104 USD	1	0	0	1	0	0	1	499.065	499			
PAGARE 105 USD	1	0	0	1	0	0	1	173.762	173			
PAGARE 106 USD	1	0	0	1	0	0	1	123.690	123			
PAGARE 107 USD	1	0	0	1	0	0	1	117.096	117			
PAGARE 108 USD	1	0	0	1	0	0	1	164.641	164			
PAGARE 109 USD	1	0	0	1	0	0	1	55.538	55			
PAGARE 110 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.054.662	1.049			
PAGARE 111 USD	1	0	0	1	0	0	1	281.713	280			
PAGARE 112 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.202.549	1.188			
PAGARE 113 USD	1	0	0	1	0	0	1	157.005	156			
PAGARE 114 USD	1	0	0	1	0	0	1	59.753	60			
PAGARE 115 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.833.067	1.826			
PAGARE 116 USD	1	0	0	1	0	0	1	126.855	126			
PAGARE 117 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.368.184	1.363			
PAGARE 118 USD	1	0	0	1	0	0	1	591.173	591			
PAGARE 119 USD	1	0	0	1	0	0	1	5.508.709	5.492			
PAGARE 120 USD	1	0	0	1	0	0	1	871.622	869			
PAGARE 121 USD	1	0	0	1	0	0	1	615.697	613			
PAGARE 122 USD	1	0	0	1	0	0	1	528.815	527			
PAGARE 123 USD	1	0	0	1	0	0	1	169.816	169			
PAGARE 124 USD	1	0	0	1	0	0	1	131.581	131			
PAGARE 125 USD	1	0	0	1	0	0	1	139.520	138			
PAGARE 126 USD	1	0	0	1	0	0	1	175.927	175			
PAGARE 127 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.061.991	1.059			
PAGARE 128 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.949.219	1.944			
PAGARE 129 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.111.552	1.105			
PAGARE 130 USD	1	0	0	1	0	0	1	122.637	122			
PAGARE 131 USD	1	0	0	1	0	0	1	186.464	186			
PAGARE 132 USD	1	0	0	1	0	0	1	902.840	899			
PAGARE 133 USD	1	0	0	1	0	0	1	6.324.204	6.314			
PAGARE 134 USD	1	0	0	1	0	0	1	7.410.202	7.406			
PAGARE 135 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.240.120	1.235			
PAGARE 136 USD	1	0	0	1	0	0	1	2.367.300	2.365			
PAGARE 137 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.091.725	1.090			
PAGARE 138 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.821.595	1.819			
PAGARE 139 USD	1	0	0	1	0	0	1	906.573	906			
PAGARE 140 USD	1	0	0	1	0	0	1	956.730	955			
PAGARE 141 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.424.826	1.423			
PAGARE 142 USD	1	0	0	1	0	0	1	3.062.505	3.061			
PAGARE 143 USD	1	0	0	1	0	0	1	3.453.096	3.449			
PAGARE 144 USD	1	0	0	1	0	0	1	3.612.009	3.604			
PAGARE 145 USD	1	0	0	1	0	0	1	757.006	755			
PAGARE 146 USD	1	0	0	1	2.795.165	2.790	1	2.698.030	2.693			
PAGARE 147 USD	1	0	0	1	760.720	760	1	734.204	733			
PAGARE 148 USD	1	0	0	1	1.180.111	1.187	1	1.146.822	1.145			
PAGARE 149 USD	1	0	0	1	7.027.540	7.005	1	6.733.333	6.764			
PAGARE 150 USD	1	0	0	1	4.384.215	4.367	1	4.231.850	4.215			
PAGARE 151 USD	1	0	0	1	593.655	593	1	563.372	563			
PAGARE 152 USD	1	0	0	1	3.196.391	3.192	1	3.095.393	3.091			
PAGARE 153 USD	1	0	0	1	1.252.691	1.251	1	1.209.149	1.205			
PAGARE 154 USD	1	0	0	1	63.512	53	1	51.652	52			
PAGARE 155 USD	1	0	0	1	491.223	491	1	474.153	474			
PAGARE 156 USD	1	0	0	1	2.177.409	2.175	1	2.101.741	2.099			
PAGARE 157 USD	1	0	0	0	0	0	1	631.701	630			
PAGARE 158 USD	1	0	0	0	0	0	1	659.562	659			
PAGARE 159 USD	1	0	0	0	0	0	1	816.503	815			
PAGARE 160 USD	1	0	0	0	0	0	1	534.172	533			
PAGARE 161 USD	1	0	0	0	0	0	1	90.532	90			
PAGARE 162 USD	1	0	0	0	0	0	1	260.190	260			
PAGARE 163 USD	1	0	0	0	0	0	1	889.749	889			
PAGARE 164 USD	1	0	0	0	0	0	1	750.670	750			
PAGARE 165 USD	1	0	0	0	0	0	1	101.502	101			
PAGARE 166 USD	1	0	0	0	0	0	1	2.047.512	2.044			
PAGARE 167 USD	1	0	0	0	0	0	1	794.100	789			
PAGARE 168 USD	1	0	0	0	0	0	1	9.810.612	9.737			
PAGARE 169 USD	1	0	0	0	0	0	1	196.217	195			
PAGARE 170 USD	1	0	0	0	0	0	1	3.767.719	3.746			
PAGARE 171 USD	1	0	0	0	0	0	1	90.460	90			
PAGARE 172 USD	1	0	0	0	0	0	1	895.774	891			
PAGARE 173 USD	1	0	0	0	0	0	1	1.903.097	1.892			
PAGARE 174 USD	1	0	0	0	0	0	1	2.913.802	2.896			
PAGARE 175 USD	1	0	0	0	0	0	1	666.152	662			
PAGARE 176 USD	1	0	0	0	0	0	1	1.056.761	1.054			
PAGARE 177 USD	1	0	0	0	0	0	1	2.673.090	2.669			
PAGARE 178 USD	1	0	0	0	0	0	1	9.353.941	9.337			
PAGARE 179 USD	1	0	0	0	0	0	1	4.664.775	4.653			
PAGARE 180 USD	1	0	0	0	0	0	1	1.959.826	1.954			
PAGARE 181 USD	1	0	0	0	0	0	1	2.919.160	2.912			
PAGARE 182 USD	1	0	0	0	0	0	1	177.539	177			
PAGARE 183 USD	1	0	0	0	0	0	1	92.470	92			
PAGARE 184 USD	1	1.201.200	1.197	0	0	0	1	1.201.200	1.197			
PAGARE 185 USD	1	802.144	879	0	0	0	1	802.144	879			
PAGARE 186 USD	1	721.292	719	0	0	0	1	721.292	719			
PAGARE 187 USD	1	2.164.132	2.154	0	0	0	1	2.164.132	2.154			
PAGARE 188 USD	1	3.909.062	3.899	0	0	0	1	3.909.062	3.899			
PAGARE 189 USD	1	2.060.343	2.059	0	0	0	1	2.060.343	2.059			
PAGARE 900 USD	1	2.821.825	2.804	0	0	0	1	2.821.825	2.804			
PAGARE 191 USD	1	1.856.322	1.846	0	0	0	1	1.856.322	1.846			
PAGARE 192 USD	1	976.540	972	0	0	0	1	976.540	972			
PAGARE 193 USD	1	1.355.172	1.352	0	0	0	1	1.355.172	1.352			
PAGARE 194 USD	1	993.910	990	0	0	0	1	993.910	990			
PAGARE 195 USD	1	1.753.823	1.747	0	0	0	1	1.753.823	1.747			
Total	0723	202	0724	21.142	1733	229	1724	30.000	2723	202	2724	420.695

CUADRO B

Serie		Grado de subordenación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses			Principal pendiente			Total Pendiente	Correcciones de valor por reperusión de pérdidas
(miles de euros)						Denominación serie	Intereses Acumulados	Intereses Impagados	Serie devenga intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal Impagado		
	PAGARE 1 EUR	NS	FUO	0,00	1,01	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 2 EUR	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 3 EUR	NS	FUO	0,00	1,95	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 4 EUR	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 5 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 6 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 7 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 8 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 9 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 10 EUR	NS	FUO	0,00	1,47	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 11 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 12 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 13 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 14 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 15 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 16 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 17 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 18 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 19 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 20 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 21 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 22 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 23 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 24 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 25 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 26 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 27 EUR	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 28 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 29 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 30 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 31 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 32 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 33 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 34 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 35 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 36 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 37 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 38 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 39 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0
	PAGARE 40 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0	0

PAGARE 41 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 42 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 43 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 44 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 45 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 46 EUR	NS	FUO	0,00	2,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 47 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 48 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 49 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 50 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 51 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 52 EUR	NS	FUO	0,00	1,62	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 53 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 54 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 55 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 56 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 57 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 58 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 59 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 60 EUR	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 61 EUR	NS	FUO	0,00	1,80	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 62 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 63 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 64 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 65 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0

PAGARE 66 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 67 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 68 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 69 EUR	NS	FUO	0,00	2,25	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 70 EUR	NS	FUO	0,00	2,73	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 71 EUR	NS	FUO	0,00	0,92	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 72 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 73 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 74 EUR	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 75 EUR	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 76 EUR	NS	FUO	0,00	1,97	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 77 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 78 EUR	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 79 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 80 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 81 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 82 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 83 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 84 EUR	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	12	0	12	0
PAGARE 85 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	199	0	199	0
PAGARE 86 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	146	0	146	0
PAGARE 87 EUR	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	167	0	167	0
PAGARE 1 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 2 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 3 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0

PAGARE 4 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 5 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 6 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 7 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 8 USD	NS	FUO	0,00	1,94	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 9 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 10 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 11 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 12 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 13 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 14 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 15 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 16 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 17 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 18 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 19 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 20 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 21 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 22 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 23 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 24 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 25 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 26 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 27 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 28 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0

PAGARE 29 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 30 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 31 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 32 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 33 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 34 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 35 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 36 USD	NS	FUO	0,00	1,45	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 37 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 38 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 39 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 40 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 41 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 42 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 43 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 44 USD	NS	FUO	0,00	1,53	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 45 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 46 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 47 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 48 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 49 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 50 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 51 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 52 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 53 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0

PAGARE 104 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 105 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 106 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 107 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 108 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 109 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 110 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 111 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 112 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 113 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 114 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 115 USD	NS	FUO	0,00	1,66	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 116 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 117 USD	NS	FUO	0,00	1,55	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 118 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 119 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 120 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 121 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 122 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 123 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 124 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 125 USD	NS	FUO	0,00	1,29	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 126 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 127 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 128 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 129 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 130 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 131 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 132 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 133 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 134 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 135 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 136 USD	NS	FUO	0,00	1,37	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 137 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 138 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 139 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 140 USD	NS	FUO	0,00	1,42	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 141 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 142 USD	NS	FUO	0,00	0,91	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 143 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 144 USD	NS	FUO	0,00	1,47	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 145 USD	NS	FUO	0,00	1,47	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 146 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 147 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 148 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 149 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 150 USD	NS	FUO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 151 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 152 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 153 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0

PAGARE 154 USD	NS	FUO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 155 USD	NS	FUO	0,00	1,30	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 156 USD	NS	FUO	0,00	1,40	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 157 USD	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 158 USD	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 159 USD	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 160 USD	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 161 USD	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 162 USD	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 163 USD	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 164 USD	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 165 USD	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 166 USD	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 167 USD	NS	FUO	0,00	1,87	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 168 USD	NS	FUO	0,00	1,98	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 169 USD	NS	FUO	0,00	2,17	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 170 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 171 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 172 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 173 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 174 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 175 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 176 USD	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 177 USD	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 178 USD	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0

PAGARE 179 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0				
PAGARE 180 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0				
PAGARE 181 USD	NS	FUO	0,00	2,13	0	0	NO	0	0	0	0				
PAGARE 182 USD	NS	FUO	0,00	2,13	0	0	NO	0	0	0	0				
PAGARE 183 USD	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0				
PAGARE 184 USD	NS	FUO	0,00	1,99	3	0	NO	1.197	0	1.200	0				
PAGARE 185 USD	NS	FUO	0,00	1,99	2	0	NO	079	0	881	0				
PAGARE 186 USD	NS	FUO	0,00	1,99	1	0	NO	719	0	721	0				
PAGARE 187 USD	NS	FUO	0,00	1,99	4	0	NO	2.154	0	2.158	0				
PAGARE 188 USD	NS	FUO	0,00	1,99	7	0	NO	3.096	0	3.905	0				
PAGARE 189 USD	NS	FUO	0,00	1,99	3	0	NO	2.059	0	2.062	0				
PAGARE 190 USD	NS	FUO	0,00	1,99	5	0	NO	2.804	0	2.809	0				
PAGARE 191 USD	NS	FUO	0,00	1,99	2	0	NO	1.846	0	1.840	0				
PAGARE 192 USD	NS	FUO	0,00	1,99	1	0	NO	972	0	973	0				
PAGARE 193 USD	NS	FUO	0,00	2,00	0	0	NO	1.352	0	1.352	0				
PAGARE 194 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	990	0	990	0				
PAGARE 195 USD	NS	FUO	0,00	1,99	0	0	NO	1.747	0	1.747	0				
Total				0740	20	0741	0	0748	21.142	0744	0	0745	21.170	0746	0

	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 19/01/2021
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0,747	1,99	0,748
			1,47
			0,749
			1,63

CUADRO C

Serie	Denominación serie	Situación actual 31/12/2023				Situación periodo comparativo anterior 31/12/2022			
		Amortización principal		Intereses		Amortización principal		Intereses	
		Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753
PAGARE 1 EUR		0	923	0	2	0	923	0	2
PAGARE 2 EUR		0	630	0	3	0	630	0	3
PAGARE 3 EUR		0	132	0	1	0	132	0	1
PAGARE 4 EUR		0	59	0	0	0	59	0	0
PAGARE 5 EUR		0	565	0	2	0	565	0	2
PAGARE 6 EUR		0	400	0	1	0	400	0	1
PAGARE 7 EUR		0	329	0	1	0	329	0	1
PAGARE 8 EUR		0	4.440	0	21	0	4.440	0	21
PAGARE 9 EUR		0	2.065	0	14	0	2.065	0	14
PAGARE 10 EUR		0	660	0	2	0	660	0	2
PAGARE 11 EUR		0	300	0	0	0	300	0	0
PAGARE 12 EUR		0	164	0	0	0	164	0	0
PAGARE 13 EUR		0	193	0	0	0	193	0	0
PAGARE 14 EUR		0	311	0	1	0	311	0	1
PAGARE 15 EUR		0	44	0	0	0	44	0	0
PAGARE 16 EUR		0	432	0	0	0	432	0	0
PAGARE 17 EUR		0	439	0	0	0	439	0	0
PAGARE 18 EUR		0	147	0	0	0	147	0	0
PAGARE 19 EUR		0	910	0	1	0	910	0	1
PAGARE 20 EUR		0	264	0	0	0	264	0	0
PAGARE 21 EUR		0	200	0	0	0	200	0	0
PAGARE 22 EUR		0	247	0	0	0	247	0	0
PAGARE 23 EUR		0	2.235	0	1	0	2.235	0	1
PAGARE 24 EUR		0	34	0	0	0	34	0	0
PAGARE 25 EUR		0	33	0	0	0	33	0	0

PAGARE 26 EUR	0	215	0	0	0	215	0	0
PAGARE 27 EUR	0	113	0	1	0	113	0	1
PAGARE 28 EUR	0	244	0	1	0	244	0	1
PAGARE 29 EUR	0	1.021	0	7	0	1.021	0	7
PAGARE 30 EUR	0	263	0	1	0	263	0	1
PAGARE 31 EUR	0	509	0	2	0	509	0	2
PAGARE 32 EUR	0	119	0	0	0	119	0	0
PAGARE 33 EUR	0	187	0	1	0	187	0	1
PAGARE 34 EUR	0	90	0	0	0	90	0	0
PAGARE 35 EUR	0	725	0	3	0	725	0	3
PAGARE 36 EUR	0	1.553	0	5	0	1.553	0	5
PAGARE 37 EUR	0	407	0	0	0	407	0	0
PAGARE 38 EUR	0	1.954	0	7	0	1.954	0	7
PAGARE 39 EUR	0	247	0	247	0	247	0	247
PAGARE 40 EUR	0	200	0	200	0	200	0	200
PAGARE 41 EUR	0	36	0	0	0	36	0	0
PAGARE 42 EUR	0	296	0	1	0	296	0	1
PAGARE 43 EUR	0	207	0	1	0	207	0	1
PAGARE 44 EUR	0	1.069	0	4	0	1.069	0	4
PAGARE 45 EUR	0	331	0	0	0	331	0	0
PAGARE 46 EUR	0	102	0	0	0	102	0	0
PAGARE 47 EUR	0	137	0	0	0	137	0	0
PAGARE 48 EUR	0	213	0	1	0	213	0	1
PAGARE 49 EUR	0	591	0	2	0	591	0	2
PAGARE 50 EUR	0	010	0	1	0	010	0	1
PAGARE 51 EUR	0	203	0	1	0	203	0	1
PAGARE 52 EUR	0	751	0	2	0	751	0	2
PAGARE 53 EUR	0	204	0	1	0	204	0	1
PAGARE 54 EUR	0	365	0	1	0	365	0	1
PAGARE 55 EUR	0	941	0	3	0	941	0	3
PAGARE 56 EUR	0	1.279	0	3	0	1.279	0	3
PAGARE 57 EUR	0	1.222	0	3	0	1.222	0	3
PAGARE 58 EUR	0	1.072	0	5	0	1.072	0	5
PAGARE 59 EUR	0	916	0	3	0	916	0	3
PAGARE 60 EUR	0	16.505	0	49	0	16.505	0	49
PAGARE 61 EUR	0	0.240	0	24	0	0.240	0	24
PAGARE 62 EUR	0	12.457	0	37	0	12.457	0	37
PAGARE 63 EUR	0	2.366	0	6	0	2.366	0	6
PAGARE 64 EUR	0	715	0	1	0	715	0	1
PAGARE 65 EUR	0	1.927	0	3	0	1.927	0	3
PAGARE 66 EUR	0	1.314	0	1	0	1.314	0	1
PAGARE 67 EUR	0	19.190	0	14	0	19.190	0	14

PAGARE 68 EUR	0	993	0	4	993	993	4	4
PAGARE 69 EUR	0	1.519	0	1	1.519	1.519	1	1
PAGARE 70 EUR	0	619	0	3	619	619	3	3
PAGARE 71 EUR	0	1.040	0	2	0	0	0	0
PAGARE 72 EUR	0	320	0	1	0	0	0	0
PAGARE 73 EUR	0	4.735	0	5	0	0	0	0
PAGARE 74 EUR	0	419	0	1	0	0	0	0
PAGARE 75 EUR	0	67	0	0	0	0	0	0
PAGARE 76 EUR	0	05	0	0	0	0	0	0
PAGARE 77 EUR	1.070	1.070	4	4	0	0	0	0
PAGARE 78 EUR	9.003	9.003	19	19	0	0	0	0
PAGARE 79 EUR	400	400	1	1	0	0	0	0
PAGARE 80 EUR	340	340	1	1	0	0	0	0
PAGARE 81 EUR	536	536	1	1	0	0	0	0
PAGARE 82 EUR	4.902	4.902	0	0	0	0	0	0
PAGARE 83 EUR	490	490	1	1	0	0	0	0
PAGARE 84 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 85 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 86 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 87 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 1 USD	0	1.406	0	5	0	1.406	0	5
PAGARE 2 USD	0	1.001	0	4	0	1.001	0	4
PAGARE 3 USD	0	372	0	1	0	372	0	1
PAGARE 4 USD	0	422	0	2	0	422	0	2
PAGARE 5 USD	0	237	0	0	0	237	0	0
PAGARE 6 USD	0	105	0	1	0	105	0	1
PAGARE 7 USD	0	930	0	5	0	930	0	5
PAGARE 8 USD	0	771	0	3	0	771	0	3
PAGARE 9 USD	0	506	0	2	0	506	0	2
PAGARE 10 USD	0	925	0	4	0	925	0	4
PAGARE 11 USD	0	1.097	0	4	0	1.097	0	4
PAGARE 12 USD	0	960	0	4	0	960	0	4
PAGARE 13 USD	0	6.472	0	7	0	6.472	0	7
PAGARE 14 USD	0	276	0	0	0	276	0	0
PAGARE 15 USD	0	688	0	1	0	688	0	1
PAGARE 16 USD	0	260	0	0	0	260	0	0
PAGARE 17 USD	0	03	0	0	0	03	0	0
PAGARE 18 USD	0	102	0	0	0	102	0	0
PAGARE 19 USD	0	320	0	0	0	320	0	0
PAGARE 20 USD	0	126	0	0	0	126	0	0
PAGARE 21 USD	0	190	0	0	0	190	0	0
PAGARE 22 USD	0	131	0	0	0	131	0	0

PAGARE 23 USD	0	524	0	3	0	524	0	3
PAGARE 24 USD	0	736	0	3	0	736	0	3
PAGARE 25 USD	0	206	0	1	0	206	0	1
PAGARE 26 USD	0	635	0	3	0	635	0	3
PAGARE 27 USD	0	467	0	2	0	467	0	2
PAGARE 28 USD	0	633	0	3	0	633	0	3
PAGARE 29 USD	0	1300	0	2	0	1300	0	2
PAGARE 30 USD	0	673	0	1	0	673	0	1
PAGARE 31 USD	0	221	0	0	0	221	0	0
PAGARE 32 USD	0	2006	0	2	0	2006	0	2
PAGARE 33 USD	0	135	0	0	0	135	0	0
PAGARE 34 USD	0	1605	0	2	0	1605	0	2
PAGARE 35 USD	0	355	0	0	0	355	0	0
PAGARE 36 USD	0	1104	0	1	0	1104	0	1
PAGARE 37 USD	0	1661	0	2	0	1661	0	2
PAGARE 38 USD	0	1267	0	1	0	1267	0	1
PAGARE 39 USD	0	240	0	1	0	240	0	1
PAGARE 40 USD	0	129	0	0	0	129	0	0
PAGARE 41 USD	0	556	0	2	0	556	0	2
PAGARE 42 USD	0	608	0	0	0	608	0	0
PAGARE 43 USD	0	242	0	0	0	242	0	0
PAGARE 44 USD	0	11656	0	47	0	11656	0	47
PAGARE 45 USD	0	1865	0	1	0	1865	0	1
PAGARE 46 USD	0	197	0	1	0	197	0	1
PAGARE 47 USD	0	977	0	1	0	977	0	1
PAGARE 48 USD	0	3056	0	14	0	3056	0	14
PAGARE 49 USD	0	206	0	0	0	206	0	0
PAGARE 50 USD	0	970	0	1	0	970	0	1
PAGARE 51 USD	0	782	0	4	0	782	0	4
PAGARE 52 USD	0	3142	0	11	0	3142	0	11
PAGARE 53 USD	0	1276	0	1	0	1276	0	1
PAGARE 54 USD	0	1971	0	1	0	1971	0	1
PAGARE 55 USD	0	1974	0	7	0	1974	0	7
PAGARE 56 USD	0	802	0	1	0	802	0	1
PAGARE 57 USD	0	1123	0	1	0	1123	0	1
PAGARE 58 USD	0	2202	0	1	0	2202	0	1
PAGARE 59 USD	0	2193	0	8	0	2193	0	8
PAGARE 60 USD	0	1010	0	1	0	1010	0	1
PAGARE 61 USD	0	466	0	1	0	466	0	1
PAGARE 62 USD	0	161	0	0	0	161	0	0
PAGARE 63 USD	0	773	0	0	0	773	0	0
PAGARE 64 USD	0	8900	0	42	0	8900	0	42
PAGARE 65 USD	0	145	0	1	0	145	0	1
PAGARE 66 USD	0	210	0	0	0	210	0	0
PAGARE 67 USD	0	2431	0	1	0	2431	0	1
PAGARE 68 USD	0	6719	0	20	0	6719	0	20
PAGARE 69 USD	0	3283	0	14	0	3283	0	14
PAGARE 70 USD	0	631	0	2	0	631	0	2
PAGARE 71 USD	0	526	0	2	0	526	0	2
PAGARE 72 USD	0	3263	0	12	0	3263	0	12
PAGARE 73 USD	0	327	0	0	0	327	0	0
PAGARE 74 USD	0	2116	0	1	0	2116	0	1
PAGARE 75 USD	0	610	0	0	0	610	0	0
PAGARE 76 USD	0	1181	0	0	0	1181	0	0
PAGARE 77 USD	0	252	0	0	0	252	0	0
PAGARE 78 USD	0	2906	0	1	0	2906	0	1
PAGARE 79 USD	0	677	0	1	0	677	0	1
PAGARE 80 USD	0	155	0	0	0	155	0	0
PAGARE 81 USD	0	809	0	3	0	809	0	3
PAGARE 82 USD	0	384	0	1	0	384	0	1
PAGARE 83 USD	0	255	0	1	0	255	0	1
PAGARE 84 USD	0	3203	0	13	0	3203	0	13
PAGARE 85 USD	0	8494	0	29	0	8494	0	29
PAGARE 86 USD	0	4280	0	15	0	4280	0	15
PAGARE 87 USD	0	902	0	3	0	902	0	3
PAGARE 88 USD	0	2759	0	10	0	2759	0	10
PAGARE 89 USD	0	89	0	0	0	89	0	0
PAGARE 90 USD	0	2472	0	1	0	2472	0	1
PAGARE 91 USD	0	358	0	0	0	358	0	0
PAGARE 92 USD	0	330	0	1	0	330	0	1
PAGARE 93 USD	0	1020	0	5	0	1020	0	5
PAGARE 94 USD	0	1325	0	5	0	1325	0	5
PAGARE 95 USD	0	2021	0	7	0	2021	0	7
PAGARE 96 USD	0	136	0	0	0	136	0	0
PAGARE 97 USD	0	1311	0	6	0	1311	0	6
PAGARE 98 USD	0	4309	0	0	0	4309	0	0
PAGARE 99 USD	0	361	0	0	0	361	0	0
PAGARE 100 USD	0	621	0	3	0	621	0	3
PAGARE 101 USD	0	8122	0	26	0	8122	0	26
PAGARE 102 USD	0	390	0	1	0	390	0	1
PAGARE 103 USD	0	589	0	0	0	589	0	0
PAGARE 104 USD	0	514	0	0	0	514	0	0
PAGARE 105 USD	0	191	0	1	0	191	0	1
PAGARE 106 USD	0	134	0	0	0	134	0	0

PAGARE 107 USD	0	126	0	0	0	126	0	0								
PAGARE 108 USD	0	170	0	1	0	170	0	1								
PAGARE 109 USD	0	57	0	0	0	57	0	0								
PAGARE 110 USD	0	2.002	0	6	0	2.002	0	6								
PAGARE 111 USD	0	310	0	1	0	310	0	1								
PAGARE 112 USD	0	1.396	0	4	0	1.396	0	4								
PAGARE 113 USD	0	173	0	1	0	173	0	1								
PAGARE 114 USD	0	65	0	0	0	65	0	0								
PAGARE 115 USD	0	1.979	0	6	0	1.979	0	6								
PAGARE 116 USD	0	140	0	0	0	140	0	0								
PAGARE 117 USD	0	1.477	0	4	0	1.477	0	4								
PAGARE 118 USD	0	609	0	0	0	609	0	0								
PAGARE 119 USD	0	5.950	0	15	0	5.950	0	15								
PAGARE 120 USD	0	942	0	2	0	942	0	2								
PAGARE 121 USD	0	664	0	2	0	664	0	2								
PAGARE 122 USD	0	571	0	1	0	571	0	1								
PAGARE 123 USD	0	163	0	0	0	163	0	0								
PAGARE 124 USD	0	145	0	1	0	145	0	1								
PAGARE 125 USD	0	143	0	0	0	143	0	0								
PAGARE 126 USD	0	194	0	1	0	194	0	1								
PAGARE 127 USD	0	1.150	0	2	0	1.150	0	2								
PAGARE 128 USD	0	2.107	0	4	0	2.107	0	4								
PAGARE 129 USD	0	1.224	0	3	0	1.224	0	3								
PAGARE 130 USD	0	133	0	0	0	133	0	0								
PAGARE 131 USD	0	212	0	0	0	212	0	0								
PAGARE 132 USD	0	1.002	0	4	1.002	1.002	4	4								
PAGARE 133 USD	0	6.841	0	9	0	6.841	0	9								
PAGARE 134 USD	0	3.025	0	11	0	3.025	0	11								
PAGARE 135 USD	0	1.360	0	2	0	1.360	0	2								
PAGARE 136 USD	0	2.563	0	2	0	2.563	0	2								
PAGARE 137 USD	0	1.181	0	1	0	1.181	0	1								
PAGARE 138 USD	0	1.971	0	2	0	1.971	0	2								
PAGARE 139 USD	0	901	0	1	0	901	0	1								
PAGARE 140 USD	0	1.065	0	1	1.065	1.065	1	1								
PAGARE 141 USD	0	1.506	0	1	1.506	1.506	1	1								
PAGARE 142 USD	0	4.303	0	2	4.303	4.303	2	2								
PAGARE 143 USD	0	3.045	0	3	3.045	3.045	3	3								
PAGARE 144 USD	0	3.030	0	7	3.030	3.030	7	7								
PAGARE 145 USD	0	804	0	2	804	804	2	2								
PAGARE 146 USD	0	2.747	0	4	0	0	0	0								
PAGARE 147 USD	0	740	0	1	0	0	0	0								
PAGARE 148 USD	0	1.160	0	1	0	0	0	0								
PAGARE 149 USD	0	7.039	0	16	0	0	0	0								
PAGARE 150 USD	0	4.203	0	14	0	0	0	0								
PAGARE 151 USD	0	574	0	1	0	0	0	0								
PAGARE 152 USD	0	3.143	0	3	0	0	0	0								
PAGARE 153 USD	0	1.232	0	1	0	0	0	0								
PAGARE 154 USD	0	53	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 155 USD	0	483	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 156 USD	0	2.141	0	2	0	0	0	0								
PAGARE 157 USD	0	652	0	1	0	0	0	0								
PAGARE 158 USD	0	663	0	1	0	0	0	0								
PAGARE 159 USD	0	243	0	1	0	0	0	0								
PAGARE 160 USD	0	551	0	1	0	0	0	0								
PAGARE 161 USD	0	102	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 162 USD	0	269	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 163 USD	0	919	0	1	0	0	0	0								
PAGARE 164 USD	0	763	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 165 USD	0	127	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 166 USD	0	2.114	0	3	0	0	0	0								
PAGARE 167 USD	709	709	4	4	0	0	0	0								
PAGARE 168 USD	9.737	9.737	60	60	0	0	0	0								
PAGARE 169 USD	195	195	1	1	0	0	0	0								
PAGARE 170 USD	3.746	3.746	10	10	0	0	0	0								
PAGARE 171 USD	90	90	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 172 USD	391	391	4	4	0	0	0	0								
PAGARE 173 USD	1.892	1.892	9	9	0	0	0	0								
PAGARE 174 USD	2.096	2.096	15	15	0	0	0	0								
PAGARE 175 USD	662	662	4	4	0	0	0	0								
PAGARE 176 USD	1.054	1.054	2	2	0	0	0	0								
PAGARE 177 USD	2.669	2.669	4	4	0	0	0	0								
PAGARE 178 USD	9.327	9.327	14	14	0	0	0	0								
PAGARE 179 USD	4.653	4.653	10	10	0	0	0	0								
PAGARE 180 USD	1.954	1.954	5	5	0	0	0	0								
PAGARE 181 USD	2.912	2.912	6	6	0	0	0	0								
PAGARE 182 USD	177	177	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 183 USD	92	92	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 184 USD	0	0	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 185 USD	0	0	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 186 USD	0	0	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 187 USD	0	0	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 188 USD	0	0	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 189 USD	0	0	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 190 USD	0	0	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 191 USD	0	0	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 192 USD	0	0	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 193 USD	0	0	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 194 USD	0	0	0	0	0	0	0	0								
PAGARE 195 USD	0	0	0	0	0	0	0	0								
Total	0754	61.390	0755	415.195	0756	128	0737	1.477	1754	19.573	1755	316.407	1756	20	1757	1.227

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (milés de euros)	Principal pendiente		
	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 19/01/2021
Inferior a 1 año	0765	21.142	1765
Entre 1 y 2 años	0766	0	1766
Entre 2 y 3 años	0767	0	1767
Entre 3 y 4 años	0768	0	1768
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770
Superior a 10 años	0771	0	1771
Total	0772	21.142	1772
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,14	1773



S.05.3

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT
Estados agregados: SI
Fecha: 31/12/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 19/01/2021	
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775		1775		2775	
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776		1776		2776	
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777		1777		2777	
1.3 Denominación de la contrapartida	0778		1778		2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786		1786		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4 Subordinación de series (SN)	0791	N	1791	N	2791	N
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100.00	1792	100.00	2792	100.00
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)			Valor en libros (miles de euros)			Otras características
	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 19/01/2021	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 19/01/2021	
Naturaleza riesgo cubierto							
Prestamos hipotecarios	0511	1011	2011	0029	1029	2029	3029
Cédulas hipotecarias	0612	1012	2012	0030	1030	2030	3030
Prestamos a promotores	0013	1013	2013	0031	1031	2031	3031
Prestamos a PYMES	0014	1014	2014	0032	1032	2032	3032
Prestamos a empresas	0515	1015	2015	0033	1033	2033	3033
Prestamos corporativos	0516	1016	2016	0034	1034	2034	3034
Cédulas inmobiliarias	0617	1017	2017	0035	1035	2035	3035
Bonos de tesorería	0018	1018	2018	0036	1036	2036	3036
Deuda subordinada	0019	1019	2019	0037	1037	2037	3037
Creditos AAPP	0020	1020	2020	0038	1038	2038	3038
Prestamos consumo	0021	1021	2021	0039	1039	2039	3039
Prestamos automoción	0022	1022	2022	0040	1040	2040	3040
Cuentas de arrendamiento financiero (leasing)	0023	1023	2023	0041	1041	2041	3041
Cuentas a cobrar	0024	1024	2024	0042	1042	2042	3042
Derechos de crédito futuro	0025	1025	2025	0043	1043	2043	3043
Bonos de titulización	0026	1026	2026	0044	1044	2044	3044
Total	0027	1027	2027	0045	1045	2045	3045

S.05.4

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT
Estados agregados: SI
Fecha: 31/12/2023

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO


CUADRO A

Concepto	Meses Impago	Días Impago	Importe impagado acumulado		Ratio			Ref. Folio						
			Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Última Fecha Pago							
1 Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	7002	360	7003	0	7006	0	7009	0.00	7012	0.00	7015	0.00	7018 ESCRITUR A DE CONSTRU CION. ANEXO 1
2 Activos Morosos por otras razones				7004	7007		7010		7013		7016			
Total Morosos:				7005	7008		7011		7014		7017			
3 Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	7020		7021	7024		7027		7030		7033		7036	7036
4 Activos Fallidos por otras razones				7022	7025		7028		7031		7034			
Total Fallidos:				7023	7026		7029		7032		7035			

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folio
	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Última Fecha Pago	
0850		1050	2050	3050
0851		1051	2051	3051
0852		1052	2052	3052
0853		1053	2053	3053

CUADRO B				
TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folio
Amortización secuencial: series	0054	0050	1050	2050
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0055	0039	1059	2059
No Reducción del Fondo de Reserva	0056	0060	1060	2060
OTROS TRIGGERS	0057	0061	1061	2061

Cuadro de texto libre

CUADRO C
Informe cumplimiento reglas de funcionamiento




Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

La información más relevante acerca del grado de cumplimiento de las reglas de funcionamiento del Fondo, previstas en la escritura de constitución de Fondo, ya se ha reflejado dentro del apartado de ratios que figura en los Estados S.05.4 cuadro A.

No se cumplimenta el Estado S.05.4 cuadro B, por no establecerse en la Escritura de constitución del Fondo ningún trigger en relación a la amortización secuencial y al diferimiento de intereses.

Así mismo, no se cumplimenta la parte de los triggers para la no reducción del Fondo de Reserva, dado que este Fondo no tiene Fondo de Reserva ni Fondo de Liquidez, El Fondo tiene una Reserva para Gastos, la cual no tiene triggers y que puede utilizar durante el primer año de vida del mismo a contar desde la Fecha de Constitución. En la última Fecha de Pago del Fondo en agosto de 2022, esta Reserva fue devuelta al Cedente.



Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

	S.06
Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT	
Estados agregados: SI	
Fecha: 31/12/2023	
NOTAS EXPLICATIVAS	
	
INFORME DE AUDITOR	
INFORME SOBRE EL CUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE RIESGOS	



Notas Explicativas

El fondo no mantiene activos disponibles para la venta, ni cobertura de flujos de efectivo, por tanto, no hay para cumplimentar en el S.04.
En S01:

La casilla 0157, denominada "otros", incluye las partidas:

- Auditoría: -5.102€
- CNMV: -573€
- AEAT: -45.030€
- Registro Mercantil: 30€
- EBN Banco: 5.252€
- Comisiones bancarias distintas a la de EBN: 524€

DILIGENCIA DE FIRMA

Diligencia que levanta la Secretaria del Consejo de Administración, Dña. Ana del Diego Monedero, para hacer constar que tras la aprobación de las cuentas anuales y el informe de gestión (incluidos los Anexos) de EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACIÓN correspondientes al ejercicio anual cerrado al 31 de diciembre de 2023, por todos los miembros del Consejo de Administración de EBN Titulización, S.A.U., S.G.F.T., en la sesión del 20 de marzo de 2024, sus miembros han procedido a suscribir el presente documento.

En Madrid, a 20 de marzo de 2024

D. Borja Galán Vanaclocha

Presidente del Consejo de Administración

D. Julio Sobremazas Moreno

Vocal del Consejo de Administración

Dña. Margarita González García

Vocal del Consejo de Administración

D. Philip André Paddack

Vocal del Consejo de Administración

Dña. Ana del Diego Monedero

Secretaria no Consejera