

Fecha de Pago / Payment Date
 Fecha de Determinación / Determination Date
 Fecha de Pago / Payment Date
 Fecha constitución Fondo / Fund establishment date

Actual / Current 15.07.2024
 Actual / Current 08.07.2024
 Precedente / Preceding 15.04.2024
 25.11.2005

1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation
1.1 Datos: Préstamos / Data: Loans

Fecha datos Data date	Valor / Importe Value / Amount	Cálculo Ratio Ratio calculation	Ratio (valor) Ratio (value)
a Saldo Vivo Certificados de Transmisión de Hipoteca Outstanding Balance Mortgage Transfer Certificates	Actual Current 08.07.2024 87.192.650,39	% (a / f)	8,72%
b Saldo Vivo Préstamos Morosos (deuda > 90 días y < 18 meses) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (> 90 days & < 18 months)	Actual Current 08.07.2024 337.285,20	% (b / k)	0,390%
c Saldo Vivo Préstamos no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Loans (Non-Doubtful)	Actual Current 08.07.2024 86.054.013,63		
d Saldo Vivo Participaciones Hipotecarias dudosas Outstanding Balance doubtful Mortgage Certificates	Actual Current 08.07.2024 464.066,36		
e Saldo Acumulado de Préstamos Fallidos (≥18 meses)	Actual Current 08.07.2024 111.685.443,90	% (e / f)	11,17%
f Saldo Vivo Préstamos Outstanding Balance Loans	Inicial Initial 25.11.2005 1.000.000.168,62	% (k / f)	8,64%
g Retención para Amortización de las Series A2a, A2b, B, C y D Series A2a, A2b, B, C & D Amortization Withholding	Actual Current 08.07.2024 3.423.536,85	F - k	
h Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A2a, A2b, B, C y D Available Funds applied for Amortization of Series A2a, A2b, B, C & D.	Actual Current 08.07.2024 3.423.536,85		
i Déficit de Amortización Amortisation Deficiency	Actual Current 08.07.2024 0,00	q - h	
j Saldo Vivo en Ejecución Hipotecaria Outstanding Balance under foreclosure	Actual Current 08.07.2024 337.285,20		
k Saldo Vivo Cartera Hipotecaria Outstanding Balance Loans	Actual Current 08.07.2024 86.391.298,83		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A Saldo Principal Pendiente Clase A2a Outstanding Principal Balance Class A2a	Precedente Preceding 15.04.2024 25.359.800,00		
B Saldo Principal Pendiente Serie A2b Outstanding Principal Balance Series A2b	Precedente Preceding 15.04.2024 11.979.969,52	% (B / F)	13,339%
C Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B	Precedente Preceding 15.04.2024 18.094.850,40	% (C / F)	20,147%
D Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C	Precedente Preceding 15.04.2024 15.051.625,56	% (D / F)	16,759%
E Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D	Precedente Preceding 15.04.2024 19.328.590,20	% (E / F)	21,520%
F Saldo Principal Pendiente Series A2a, A2b, B, C y D Outstanding Principal Balance Series A2a, A2b, B, C and D	Precedente Preceding 15.04.2024 89.814.835,68		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Precedente / Preceding 15.04.2024 8.000.000,00		
n Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Precedente / Preceding 15.04.2024 8.000.000,00	(n - m)	0,00
o Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Actual / Current 15.07.2024 8.000.000,00		
p Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Actual / Current 15.07.2024 8.000.000,00	(p - o)	0,00

2 Situación disparadores / Triggers status
2.1 Pago intereses Series B, C y D: postergación lugar orden de prelación
Interest payment of Series B, C & D: place deferred in priority of payments

Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Actúa S/N Breach Y/N
2.1.1 Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (*)				N
(i) Saldo Acumulado de Préstamos Fallidos / Saldo Vivo Préstamos Inicial	08.07.2024	% (e/f) ≥ 13,82%	11,17%	N
(ii) Suma Saldo Principal Pendiente Clase Serie A2a y A2b	08.07.2024	A+B > 0,00	37.339.769,52	S/Y
2.1.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (*)				S/Y
(i) Saldo Acumulado de Préstamos Fallidos / Saldo Vivo Préstamos Inicial	08.07.2024	% (e/f) ≥ 10,39%	11,17%	S/Y
(ii) Suma Saldo Principal Pendiente Clase Serie A2a, A2b y B	08.07.2024	A+B+C > 0,00	55.434.619,92	S/Y
2.1.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (*)				S/Y
(i) Saldo Acumulado de Préstamos Fallidos / Saldo Vivo Préstamos Inicial	08.07.2024	% (e/f) ≥ 7,00%	11,17%	S/Y
(ii) Suma Saldo Principal Pendiente Clase Serie A2a, A2b, B y C	08.07.2024	A+B+C+D > 0,00	70.486.245,48	S/Y
2.2 Amortización a Prorrata Series B, C y D Pro Rata Amortisation of Series B, C y D				
2.2.1 Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (*)				N
(i) Ratio de morosidad.	08.07.2024	% (b / k) < 1,500%	0,390%	S/Y
(ii) Saldo Bono Serie B / Saldo Principal Pendiente Series A2a, A2b, B, C y D	08.07.2024	% (C / F) ≥ 4,40%	20,15%	S/Y
(iii) FR Requerido FP Precedente es igual al FR Dotado.	08.07.2024	(n - m) = 0,00	0,00	S/Y
(iv) Saldo Vivo CTH / Saldo Vivo Préstamos inicial	08.07.2024	% (a / f) > 10,00%	8,72%	N
2.2.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (*)				N
(i) Ratio de morosidad.	08.07.2024	% (b / k) < 1,250%	0,390%	S/Y
(ii) Saldo Bono Serie C / Saldo Principal Pendiente Series A2a, A2b, B, C y D	08.07.2024	% (D / F) ≥ 3,66%	16,76%	S/Y
(iii) FR Requerido FP Precedente es igual al FR Dotado.	08.07.2024	(n - m) = 0,00	0,00	S/Y
(iv) Saldo Vivo CTH / Saldo Vivo Préstamos inicial	08.07.2024	% (a / f) > 10,00%	8,72%	N
2.2.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (*)				N
(i) Ratio de morosidad.	08.07.2024	% (b / k) < 1,000%	0,390%	S/Y
(ii) Saldo Bono Serie D / Saldo Principal Pendiente Series A2a, A2b, B, C y D	08.07.2024	% (E / F) ≥ 4,70%	21,52%	S/Y
(iii) FR Requerido FP Precedente es igual al FR Dotado.	08.07.2024	(n - m) = 0,00	0,00	S/Y
(iv) Saldo Vivo CTH / Saldo Vivo Préstamos inicial	08.07.2024	% (a / f) > 10,00%	8,72%	N

2.3 Reducción Fondo Reserva Requerido: condiciones de no reducción ():**
NO PROCEDE SE ENCUENTRA EN EL MÍNIMO
3 Amortización Anticipada opcional / Optional Early Amortization

Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Opción ejercitable S/N Exercisable option Y/N
08.07.2024	% (a / f)	< 10,00%	8,72%	S/Y