

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO, FONDO DE TITULIZACION
Número de registro del Fondo: 202100000
NIF Fondo: V42788216
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento: 202100000
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION, S.A., SGFT
NIF Gestora: A88248166
Fondo Abierto: SI
Fondo Privado: SI
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2022

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:
(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

S.01

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001		1001	
I. Activos financieros a largo plazo	0002		1002	
1. Activos titulizados	0003		1003	
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025		1025	
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027		1027	
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

S.01

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	61.696	1041	36
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	61.691	1043	
1. Activos titulizados	0044	61.691	1044	
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	0	1046	
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048	0	1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049	0	1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050	0	1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051	0	1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052	0	1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053	0	1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054	0	1054	
1.11 Deuda subordinada	0055	0	1055	
1.12 Créditos AAPP	0056	0	1056	
1.13 Préstamos consumo	0057	0	1057	
1.14 Préstamos automoción	0058	0	1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	
1.16 Cuentas a cobrar	0060	61.405	1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061	0	1061	0
1.18 Bonos de titulación	0062	0	1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063	0	1063	0
1.20 Otros	0064	0	1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	286	1065	0
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	0	1066	
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	0	1067	0
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	0	1068	
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	0	1069	
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074		1074	
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077		1077	
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082		1082	
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084		1084	
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	5	1085	36
1. Tesorería	0086	5	1086	36
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	61.696	1088	36

S.01

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089		1089	
I. Provisiones a largo plazo	0090		1090	
1. Provisión garantías financieras	0091		1091	
2. Provisión por margen de intermediación	0092		1092	
3. Otras provisiones	0093		1093	
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094		1094	
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095		1095	
1.1 Series no subordinadas	0096		1096	
1.2 Series subordinadas	0097		1097	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101		1101	
2.1 Préstamo subordinado	0102		1102	
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105		1105	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108		1108	
3.1 Derivados de cobertura	0109		1109	
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

S.01

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
B) PASIVO CORRIENTE	0117	61.696	1117	36
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	
V. Provisiones a corto plazo	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120		1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121		1121	
3. Otras provisiones	0122		1122	
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	61.570	1123	4
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	61.562	1124	
1.1 Series no subordinadas	0125	61.405	1125	
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	157	1128	
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	4	1131	4
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	4
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	4	1134	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	0	1136	
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	
3. Derivados	0139		1139	
3.1 Derivados de cobertura	0140		1140	
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	4	1143	
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	4	1144	
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	
4.3 Otros	0146	0	1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	126	1148	32
1. Comisiones	0149	125	1149	18
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	26	1150	5
1.2 Comisión administrador	0151	63	1151	9
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	27	1153	4
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	9	1156	0
2. Otros	0157	1	1157	13
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158		1158	
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160		1160	
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	61.696	1162	36

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	294	1201	31	2201	304	3201	39
1.1 Activos titulizados	0202	294	1202	31	2202	304	3202	39
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203		2203	0	3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-161	1204	-9	2204	-166	3204	-13
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-161	1205	-9	2205	-166	3205	-13
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	0	1206		2206	0	3206	
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207		2207	0	3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	0	1208		2208	0	3208	
A) MARGEN DE INTERESES	0209	133	1209	21	2209	138	3209	26
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210		1210		2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211		2211	0	3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212		2212	0	3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213		2213	0	3213	
4.4 Otros	0214	0	1214		2214	0	3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215		2215	0	3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	0	3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-127	1217	-21	2217	-138	3217	-30
7.1 Servicios exteriores	0218	-1	1218	-1	2218	-3	3218	-7
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	-1	2219	-3	3219	-7
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223		2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-125	1224	-20	2224	-134	3224	-23
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-27	1225	-3	2225	-30	3225	-4
7.3.2 Comisión administrador	0226	-68	1226	-5	2226	-72	3226	-6
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227	0	3227	0
7.3.4 Comisión variable	0228	-20	1228	-13	2228	-23	3228	-13
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-10	1230	0	2230	-10	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231		1231		2231		3231	
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232		2232	0	3232	
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233		2233	0	3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234		1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235		2235	0	3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236		2236	0	3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237		2237	0	3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238		2238	0	3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-6	1239	0	2239	0	3239	5
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240		1240		2240		3240	
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241		2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	2	1300	-10	2300	-17	3300	-15
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	10	1301	-6	2301	10	3301	-6
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	18	1302		2302	18	3302	
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-7	1303	-6	2303	-7	3303	-6
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304		2304	0	3304	
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305		2305	0	3305	
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306		2306	0	3306	
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-8	1309	-5	2309	-27	3309	-10
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-2	1310	-2	2310	-9	3310	-2
2.2 Comisión administrador	0311	-5	1311	-3	2311	-17	3311	-3
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	-1	1314	0	2314	-1	3314	-5
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315		1315		2315		3315	
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316		2316	0	3316	
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317		2317	0	3317	
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318		2318	0	3318	
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319		2319	0	3319	
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-4	1322	13	2322	-14	3322	22
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	55.703	1323	5.078	2323	70.521	3323	7.387
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	-55.703	1324	-5.078	2324	-70.521	3324	-7.387
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325		1325	13	2325		3325	13
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	9.116	1326	1.756	2326	9.116	3326	1.756
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	0	1327		2327	0	3327	
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	0	1328		2328	0	3328	
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329		2329	0	3329	
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330		2330	0	3330	
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-9.116	1331	-1.744	2331	-9.116	3331	-1.744
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-4	1332	0	2332	-14	3332	9
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333		2333	0	3333	9
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334		2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	-2	1335	0	2335	-14	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-2	1336	0	2336	0	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-2	1337	2	2337	-31	3337	6
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	7	1338	4	2338	36	3338	0
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	5	1339	6	2339	5	3339	6

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350		1350		2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351		1351		2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352		1352		2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353		1353		2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354		1354		2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0355		1355		2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356		1356		2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357		1357		2357		3357	
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358		1358		2358		3358	
2.1.2 Efecto fiscal	0359		1359		2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360		1360		2360		3360	
2.3 Otras reclasificaciones	0361		1361		2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362		1362		2362		3362	
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363		1363		2363		3363	
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	0364		1364		2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365		1365		2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366		1366		2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367		1367		2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368		1368		2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369		1369		2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370		1370		2370		3370	

S.05.1

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: ZEPA FINANCE, S.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2022								Situación cierre anual anterior 31/12/2021								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		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	
Préstamos 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	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos 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	
Créditos 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	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395	0,00	0415	0,00	0435	0,00	0455	0,00	1395	0,00	1415	0,00	1435	0,00	1455	0,00	2395	0,00	2415	0,00	2435	0,00	2455	0,00
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	

S.05.1

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: ZEPA FINANCE, S.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

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		1515	

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	

S.05.1

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: ZEPA FINANCE, S.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 19/01/2021	
Inferior a 1 año	0600	61.405	1600	0	2600	81.441
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	61.405	1607		2607	81.441
Vida residual media ponderada (años)	0608	0,09	1608	0,00	2608	0,24

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 19/01/2021	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	0,23	1609	0,00	2609	0,07

S.05.1

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: ZEPA FINANCE, S.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	

S.05.1

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: ZEPA FINANCE, S.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 19/01/2021	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,00	1650	0,00	2650	3,01
Tipo de interés nominal máximo	0651	3,00	1651	0,00	2651	3,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	3,00	1652	0,00	2652	3,00

S.05.1

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: ZEPA FINANCE, S.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	0683	0	1660	0	1683	0	2660	0	2683	0
Aragón	0661	0	0684	0	1661	0	1684	0	2661	0	2684	0
Asturias	0662	0	0685	0	1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663	0	0686	0	1663	0	1686	0	2663	0	2686	0
Canarias	0664	0	0687	0	1664	0	1687	0	2664	0	2687	0
Cantabria	0665	0	0688	0	1665	0	1688	0	2665	0	2688	0
Castilla-León	0666	0	0689	0	1666	0	1689	0	2666	0	2689	0
Castilla La Mancha	0667	0	0690	0	1667	0	1690	0	2667	0	2690	0
Cataluña	0668	0	0691	0	1668	0	1691	0	2668	0	2691	0
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	0	2693	0
Galicia	0671	0	0694	0	1671	0	1694	0	2671	0	2694	0
Madrid	0672	99	0695	61.405	1672	0	1695	0	2672	192	2695	81.441
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	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	99	0702	61.405	1679		1702		2679	192	2702	81.441
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680		2703	
Resto	0681		0704		1681		1704		2681		2704	
Total general	0682	99	0705	61.405	1682		1705		2682	192	2705	81.441

S.05.1
Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT
Denominación del compartimento: 202100000
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2022
Entidades cedentes de los activos titulizados: ZEPA FINANCE, S.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Situación inicial 19/01/2021			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	100,00			1710	0,00			2710	100,00		
Sector	0711	87,41	0712	7.112	1711	0,00	1712		2711	87,33	2712	7.112

S.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: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2022			Situación cierre anual anterior 31/12/2021			Situación inicial 19/01/2021		
Serie	Denominación serie	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	0	0	0	1	925.722	923
	PAGARE 2 EUR	1	0	0	0	0	0	1	633.164	630
	PAGARE 3 EUR	1	0	0	0	0	0	1	132.304	132
	PAGARE 4 EUR	1	0	0	0	0	0	1	59.583	59
	PAGARE 5 EUR	1	0	0	0	0	0	1	567.768	565
	PAGARE 6 EUR	1	0	0	0	0	0	1	402.139	400
	PAGARE 7 EUR	1	0	0	0	0	0	1	230.375	229
	PAGARE 8 EUR	1	0	0	0	0	0	1	4.474.043	4.448
	PAGARE 9 EUR	1	0	0	0	0	0	1	2.882.457	2.865
	PAGARE 10 EUR	1	0	0	0	0	0	1	671.134	668
	PAGARE 11 EUR	1	0	0	0	0	0	1	299.762	300
	PAGARE 12 EUR	1	0	0	0	0	0	1	164.206	164
	PAGARE 13 EUR	1	0	0	0	0	0	1	193.284	193
	PAGARE 14 EUR	1	0	0	0	0	0	1	811.550	811
	PAGARE 15 EUR	1	0	0	0	0	0	1	44.086	44
	PAGARE 16 EUR	1	0	0	0	0	0	1	432.952	432
	PAGARE 17 EUR	1	0	0	0	0	0	1	439.011	439
	PAGARE 18 EUR	1	0	0	0	0	0	1	147.006	147
	PAGARE 19 EUR	1	0	0	0	0	0	1	910.818	910
	PAGARE 20 EUR	1	0	0	0	0	0	1	264.523	264
	PAGARE 21 EUR	1	0	0	0	0	0	1	280.589	280
	PAGARE 22 EUR	1	0	0	0	0	0	1	247.176	247
	PAGARE 23 EUR	1	0	0	0	0	0	1	2.236.612	2.235
	PAGARE 24 EUR	1	0	0	0	0	0	1	33.598	34
	PAGARE 25 EUR	1	0	0	0	0	0	1	37.741	38
	PAGARE 26 EUR	1	0	0	0	0	0	1	215.564	215

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

PAGARE 27 EUR	1	0	0	0	0	0	1	113.953	113
PAGARE 28 EUR	1	245.274	244	0	0	0	1	245.274	244
PAGARE 29 EUR	1	1.830.085	1.821	0	0	0	1	1.830.085	1.821
PAGARE 30 EUR	1	264.571	263	0	0	0	1	264.571	263
PAGARE 31 EUR	1	591.753	589	0	0	0	1	591.753	589
PAGARE 32 EUR	1	119.245	119	0	0	0	1	119.245	119
PAGARE 33 EUR	1	187.979	187	0	0	0	1	187.979	187
PAGARE 34 EUR	1	90.617	90	0	0	0	1	90.617	90
PAGARE 35 EUR	1	728.163	725	0	0	0	1	728.163	725
PAGARE 36 EUR	1	1.559.437	1.553	0	0	0	1	1.559.437	1.553
PAGARE 37 EUR	1	0	0	0	0	0	1	407.535	407
PAGARE 38 EUR	1	1.962.583	1.954	0	0	0	1	1.962.583	1.954
PAGARE 39 EUR	1	0	0	0	0	0	1	247.034	247
PAGARE 40 EUR	1	0	0	0	0	0	1	208.383	208
PAGARE 41 EUR	1	36.148	36	0	0	0	1	36.148	36
PAGARE 42 EUR	1	296.901	296	0	0	0	1	296.901	296
PAGARE 43 EUR	1	288.546	287	0	0	0	1	288.546	287
PAGARE 44 EUR	1	1.073.628	1.069	0	0	0	1	1.073.628	1.069
PAGARE 45 EUR	1	0	0	0	0	0	1	330.922	331
PAGARE 46 EUR	1	0	0	0	0	0	1	102.114	102
PAGARE 47 EUR	1	0	0	0	0	0	1	136.756	137
PAGARE 48 EUR	1	214.093	213	0	0	0	1	214.093	213
PAGARE 49 EUR	1	593.597	591	0	0	0	1	593.597	591
PAGARE 50 EUR	1	0	0	0	0	0	1	819.260	818
PAGARE 51 EUR	1	284.226	283	0	0	0	1	284.226	283
PAGARE 52 EUR	1	754.131	751	0	0	0	1	754.131	751
PAGARE 53 EUR	1	204.850	204	0	0	0	1	204.850	204
PAGARE 54 EUR	1	366.318	365	0	0	0	1	366.318	365
PAGARE 55 EUR	1	945.262	941	0	0	0	1	945.262	941
PAGARE 56 EUR	1	1.283.216	1.279	0	0	0	1	1.283.216	1.279
PAGARE 57 EUR	1	1.226.112	1.222	0	0	0	1	1.226.112	1.222
PAGARE 58 EUR	1	1.878.338	1.872	0	0	0	1	1.878.338	1.872
PAGARE 59 EUR	1	919.375	916	0	0	0	1	919.375	916
PAGARE 60 EUR	1	16.564.984	16.505	0	0	0	1	16.564.984	16.505
PAGARE 61 EUR	1	8.278.531	8.248	0	0	0	1	8.278.531	8.248
PAGARE 62 EUR	1	12.502.488	12.457	0	0	0	1	12.502.488	12.457
PAGARE 63 EUR	1	2.373.444	2.366	0	0	0	1	2.373.444	2.366
PAGARE 64 EUR	1	716.711	715	0	0	0	1	716.711	715
PAGARE 65 EUR	1	1.930.935	1.927	0	0	0	1	1.930.935	1.927
PAGARE 66 EUR	1	1.315.383	1.314	0	0	0	1	1.315.383	1.314

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Total		0723	66		0724	61.405	1723	0		1724	0	2723	66		2724	81.441
--------------	--	------	----	--	------	--------	------	---	--	------	---	------	----	--	------	--------

S.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: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado		
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739
	PAGARE 1 EUR	NS	FIJO	0,00	1,01	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 2 EUR	NS	FIJO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 3 EUR	NS	FIJO	0,00	1,95	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 4 EUR	NS	FIJO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 5 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 6 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 7 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 8 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 9 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 10 EUR	NS	FIJO	0,00	1,47	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 11 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 12 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 13 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 14 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 15 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

PAGARE 16 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 17 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 18 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 19 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 20 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 21 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 22 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 23 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 24 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 25 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 26 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 27 EUR	NS	FIJO	0,00	1,99	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 28 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	1	0	NO	244	0	245	0
PAGARE 29 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	8	0	NO	1.821	0	1.829	0
PAGARE 30 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	1	0	NO	263	0	264	0
PAGARE 31 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	3	0	NO	589	0	591	0
PAGARE 32 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	119	0	119	0
PAGARE 33 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	1	0	NO	187	0	188	0
PAGARE 34 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	90	0	91	0
PAGARE 35 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	3	0	NO	725	0	728	0
PAGARE 36 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	6	0	NO	1.553	0	1.559	0
PAGARE 37 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 38 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	7	0	NO	1.954	0	1.961	0
PAGARE 39 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 40 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

PAGARE 41 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	36	0	36	0
PAGARE 42 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	1	0	NO	296	0	297	0
PAGARE 43 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	1	0	NO	287	0	288	0
PAGARE 44 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	4	0	NO	1.069	0	1.073	0
PAGARE 45 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 46 EUR	NS	FIJO	0,00	2,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 47 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 48 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	1	0	NO	213	0	214	0
PAGARE 49 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	2	0	NO	591	0	593	0
PAGARE 50 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 51 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	1	0	NO	283	0	284	0
PAGARE 52 EUR	NS	FIJO	0,00	1,62	2	0	NO	751	0	754	0
PAGARE 53 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	1	0	NO	204	0	205	0
PAGARE 54 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	1	0	NO	365	0	366	0
PAGARE 55 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	3	0	NO	941	0	944	0
PAGARE 56 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	3	0	NO	1.279	0	1.283	0
PAGARE 57 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	3	0	NO	1.222	0	1.225	0
PAGARE 58 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	5	0	NO	1.872	0	1.877	0
PAGARE 59 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	2	0	NO	916	0	918	0
PAGARE 60 EUR	NS	FIJO	0,00	1,99	43	0	NO	16.505	0	16.548	0
PAGARE 61 EUR	NS	FIJO	0,00	1,80	20	0	NO	8.248	0	8.268	0
PAGARE 62 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	25	0	NO	12.457	0	12.482	0
PAGARE 63 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	5	0	NO	2.366	0	2.371	0
PAGARE 64 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	1	0	NO	715	0	716	0
PAGARE 65 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	3	0	NO	1.927	0	1.930	0

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

	PAGARE 66 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	1.314	0	1.315	0					
Total						0740	157	0741	0	0743	61.405	0744	0	0745	61.562	0746	0

	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 19/01/2021	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	1,67	0748	0,00	0749	1,65

S.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: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2022				Situación periodo comparativo anterior 30/06/2021			
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 EUR	0	923	0	2	923	923	2	2
	PAGARE 2 EUR	0	630	0	3	630	630	3	3
	PAGARE 3 EUR	0	132	0	1	132	132	1	1
	PAGARE 4 EUR	0	59	0	0	59	59	0	0
	PAGARE 5 EUR	0	565	0	2	0	0	0	0
	PAGARE 6 EUR	0	400	0	1	0	0	0	0
	PAGARE 7 EUR	0	229	0	1	0	0	0	0
	PAGARE 8 EUR	0	4.448	0	21	0	0	0	0
	PAGARE 9 EUR	0	2.865	0	14	0	0	0	0
	PAGARE 10 EUR	0	668	0	2	0	0	0	0
	PAGARE 11 EUR	300	300	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 12 EUR	164	164	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 13 EUR	193	193	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 14 EUR	811	811	1	1	0	0	0	0
	PAGARE 15 EUR	44	44	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 16 EUR	432	432	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 17 EUR	439	439	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 18 EUR	147	147	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 19 EUR	910	910	1	1	0	0	0	0
	PAGARE 20 EUR	264	264	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 21 EUR	280	280	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 22 EUR	247	247	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 23 EUR	2.235	2.235	1	1	0	0	0	0
	PAGARE 24 EUR	34	34	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 25 EUR	38	38	0	0	0	0	0	0

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

	PAGARE 26 EUR	215	215	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 27 EUR	113	113	1	1	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 28 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 29 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 30 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 31 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 32 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 33 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 34 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 35 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 36 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 37 EUR	407	407	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 38 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 39 EUR	247	247	0	247	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 40 EUR	208	208	0	208	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 41 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 42 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 43 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 44 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 45 EUR	331	331	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 46 EUR	102	102	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 47 EUR	137	137	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 48 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 49 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 50 EUR	818	818	1	1	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 51 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 52 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 53 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 54 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 55 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 56 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 57 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 58 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 59 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 60 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 61 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 62 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 63 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 64 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 65 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 66 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Total		0754	9.116	0755	20.036	0756	7	0757	510	1754	1.744	1755	1.744	1756	6	1757	6

S.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: 30/06/2022
 Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Situación inicial 19/01/2021
		0760	0761	0762	0763	0764

S.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: 30/06/2022
Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 19/01/2021	
Inferior a 1 año	0765	61.405	1765		2765	81.441
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	61.405	1772		2772	81.441
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,22	1773		2773	0,22

S.05.3

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		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/s 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 (S/N)	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	0,00	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	

S.05.3

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características		
Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Situación inicial 19/01/2021			
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806		
Total						0808		0809		0810	

S.05.3

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 19/01/2021		Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 19/01/2021			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

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 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Situación actual 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	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	ESCRITUR A DE CONSTRU CION. 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 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Última Fecha Pago		
	0850	1850	2850	3850	
	0851	1851	2851	3851	
	0852	1852	2852	3852	
	0853	1853	2853	3853	

S.05.4

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		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	0862	EBN TITULIZACION S.A.U., S.G.F.T.	1862		2862	SALDO MEDIO VALOR NOMINAL DC	3862	0,500	4862		5862	10	6862	TRIMESTRAL	7862	N	8862	EL MÍNIMO ES ANUALMENTE
Comisión administrador	0863	BORROX FINANCE S.L.	1863		2863	SALDO MEDIO VALOR NOMINAL DC	3863	0,900	4863		5863		6863	TRIMESTRAL	7863	N	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	EBN BANCO DE NEGOCIOS, S.A.	1864		2864		3864		4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	N	8864	EN FUNCIÓN DEL NÚMERO DE TRANSFERENCIAS
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT
Denominación del compartimento: 202100000
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2022

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	S
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	N
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	ZEPA FINANCE, S.L.
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo							Total	
		31/01/2022	28/02/2022	31/03/2022	30/04/2022	31/05/2022	30/06/2022			
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872									
Margen de intereses	0873		0	5	19	48	66			138
Deterioro de activos financieros (neto)	0874									
Dotaciones a provisiones (neto)	0875									
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876									
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-3	-3	-2	-14	-41	-53			-115
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	-3	-3	3	5	7	13			23
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879									
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880			-3	-3					-6
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881				-2	-7	-13			-23
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	3	3		0					6
Comisión variable pagada	0883									
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884	4	4	4	6	14	27			

S.05.5

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100000

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885												
Saldo inicial	0886												
Cobros del periodo	0887												
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888												
Pagos por derivados	0889												
Retención importe Fondo de Reserva	0890												
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891												
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892												
Resto pagos/retenciones	0893												
Saldo disponible	0894												
Liquidación de comisión variable	0895												

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: 30/06/2022

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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