

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

Actual / Current **20.09.2023**
 Actual / Current **13.09.2023**
 Precedente / Preceding **20.06.2023**
19.06.2009

1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation

| | | | Fecha datos Data date | Valor / Importe Value / Amount | Cálculo Ratio Ratio calculation | Ratio (valor) Ratio (value) |
|-----------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--------------------------------|
| 1.1 Datos: Préstamos Hipotecarios / Data: Mortgage Loans | | | | | | |
| a | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i> | (b + c + d) | | 12.024.684,59 | | |
| b | Saldo Vivo Préstamos Morosos <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans</i> | (>3 y <12 meses) | Actual Current | 37.787,80 | % (b / (a - d)) | 0,316% |
| c | Préstamo fallidos <i>Failed Loans</i> | (>3 y <12 meses) | Actual Current | 117.126,86 | % ((c+d) / (a-d)) | 1,669% |
| d | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i> | (≥12 meses) | Actual Current | 82.190,32 | | |
| e | Retención para Amortización de las Series AG, B(CA), C(CA) <i>Series AG, B(CA), C(CA) Amortisation Withholding</i> | (≥12 meses) | Actual Current | 1.463.715,26 | | |
| f | Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CA), C(CA) <i>Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CA), C(CA)</i> | | Actual Current | 1.463.715,26 | | |
| g | Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i> | | Actual Current | 0,00 | | |
| h | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i> | | Initial Initial | 277.017.643,68 | | |

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

| | | | | | | |
|---|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------|------------|---------------|--|
| A | Saldo Principal Pendiente Clase AG <i>Outstanding Principal Balance Class A</i> | | Precedente Preceding | 20.06.2023 | 406.210,00 | |
| B | Saldo Principal Pendiente Serie B (CA) <i>Outstanding Principal Balance Series B(CA)</i> | | Precedente Preceding | 20.06.2023 | 9.800.000,00 | |
| C | Saldo Principal Pendiente Serie C (CA) <i>Outstanding Principal Balance Series C(CA)</i> | | Precedente Preceding | 20.06.2023 | 3.200.000,00 | |
| D | Saldo Principal Pendiente Serie D (CA) <i>Outstanding Principal Balance Series D(CA)</i> | | Precedente Preceding | 20.06.2023 | 3.168.108,20 | |
| E | Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CA) y C (CA) <i>Outstanding Principal Balance Series AG, B (CA), C(CA)</i> | | Precedente Preceding | 20.06.2023 | 13.406.210,00 | |

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

| | | | | | | |
|---|------------------------------------------------------------------|--|------------------------------------------|------------|--------------|--------------|
| m | Fondo de Reserva Requerido CA <i>Required Cash Reserve CA</i> | | Precedente Preceding | 20.06.2023 | 3.050.000,00 | |
| n | Fondo de Reserva dotado CA <i>Provisioned Cash Reserve CA</i> | | Precedente Preceding | 20.06.2023 | 3.050.000,00 | (n - m) 0,00 |
| o | Fondo de Reserva Requerido CA / Required Cash Reserve CA | | Actual / Currently Actual / Currently | 20.09.2023 | 3.050.000,00 | |
| p | Fondo de Reserva dotado CA / Provisioned Cash Reserve CA | | Actual / Currently Actual / Currently | 20.09.2023 | 3.050.000,00 | (p - o) 0,00 |

2 Situación disparadores / Triggers status
2.2 Pago intereses Series B y C: postergación lugar orden de prelación

| | Fecha datos Data date | Disparador Trigger | Condición Condition | Valor Disparador Trigger value | Actúa S/N Breach Y/N |
|--------------------------|--------------------------|-----------------------|------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| 2.2.1 Serie B / Series B | 20.09.2023 | g | > (50% * B) + C | 8.100.000,00 | N |
| 2.2.2 Serie C / Series C | 20.09.2023 | g | > (50% * C) | 1.600.000,00 | N |

2.3 Fondo de Reserva:

Cash Reserve:

2.3.1 Condiciones de no reducción

Conditions Cash Reserve reduction(**)

NO PROCEDE POR ESTAR EN EL MINIMO
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 |
|--------------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------|
| 13.09.2023 | % ((a-d) / h) | < 10,00% | 4,31% | SY |

(**) No procede reducción si se da alguna de las condiciones / Do not proceed reduction if any condition concurs

(*) Condición Global de todos los cedentes.

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

Actual / Current **20.09.2023**
 Actual / Current **13.09.2023**
 Precedente / Preceding **20.06.2023**
19.06.2009

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

| a | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios | (b + c + d) | Actual |
|---|----------------------------------------------------------------------------|------------------|---------|
| | <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i> | | Current |
| b | Saldo Vivo Préstamos Morosos | (>3 y <12 meses) | Actual |
| | <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans</i> | (>3 y <12 meses) | Current |
| c | Préstamo fallidos | | Actual |
| | <i>Failed Loans</i> | | Current |
| d | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos | (≥12 meses) | Actual |
| | <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i> | (≥12 months) | Current |
| e | Retención para Amortización de las Series AG, B(CM), C(CM) | | Actual |
| | <i>Series AG, B(CM), C(CM) Amortisation Withholding</i> | | Current |
| f | Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CM), C(CM) | | Actual |
| | <i>Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CM), C(CM)</i> | | Current |
| g | Déficit de Amortización | | Actual |
| | <i>Amortisation Deficiency</i> | | Current |
| h | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios | | Initial |
| | <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i> | | Initial |

| Fecha datos | Valor / Importe | Cálculo Ratio | Ratio (valor) |
|-------------|-----------------|-------------------|---------------|
| Data date | Value / Amount | Ratio calculation | Ratio (value) |
| | 3.884.809,94 | | |
| 13.09.2023 | 0,00 | % (b / (a - d)) | 0,000% |
| 13.09.2023 | 104.297,87 | % ((c+d) / (a-d)) | 4,054% |
| 13.09.2023 | 51.130,16 | | |
| 13.09.2023 | 452.644,17 | | |
| 13.09.2023 | 452.644,17 | | |
| 20.09.2023 | 0,00 | | |
| 19.06.2009 | 74.458.609,46 | | |

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

| | | | |
|---|---------------------------------------------------------------|--|------------|
| A | Saldo Principal Pendiente Clase AG | | Precedente |
| | <i>Outstanding Principal Balance Class A</i> | | Preceding |
| B | Saldo Principal Pendiente Serie B (CM) | | Precedente |
| | <i>Outstanding Principal Balance Series B(CM)</i> | | Preceding |
| C | Saldo Principal Pendiente Serie C (CM) | | Precedente |
| | <i>Outstanding Principal Balance Series C(CM)</i> | | Preceding |
| D | Saldo Principal Pendiente Serie D (CM) | | Precedente |
| | <i>Outstanding Principal Balance Series D(CM)</i> | | Preceding |
| E | Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CM), C (CM) | | Precedente |
| | <i>Outstanding Principal Balance Series AG, B (CM), C(CM)</i> | | Preceding |

| | | | |
|------------|--------------|--|--|
| 20.06.2023 | 0,00 | | |
| 20.06.2023 | 1.986.324,12 | | |
| 20.06.2023 | 2.300.000,00 | | |
| 20.06.2023 | 2.173.162,25 | | |
| 20.06.2023 | 4.286.324,12 | | |

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

| | | | |
|---|----------------------------------------------------------|--|------------------|
| m | Fondo de Reserva Requerido CM | | Precedente |
| | <i>Required Cash Reserve CM</i> | | Preceding |
| n | Fondo de Reserva dotado CM | | Precedente |
| | <i>Provisioned Cash Reserve CM</i> | | Preceding |
| o | Fondo de Reserva Requerido CM / Required Cash Reserve CM | | Actual / Current |
| | <i>Required Cash Reserve CM</i> | | Actual / Current |
| p | Fondo de Reserva dotado CM / Provisioned Cash Reserve CM | | Actual / Current |
| | <i>Provisioned Cash Reserve CM</i> | | Actual / Current |

| | | | |
|------------|--------------|---------|------|
| 20.06.2023 | 1.922.166,70 | | |
| 20.06.2023 | 1.922.166,70 | (n - m) | 0,00 |
| 20.09.2023 | 1.922.166,70 | | |
| 20.09.2023 | 1.922.166,70 | (p - o) | 0,00 |

2 Situación disparadores / Triggers status

| Fecha datos | Disparador | Condición | Valor Disparador | Actúa S/N |
|-------------|------------|-----------|------------------|------------|
| Data date | Trigger | Condition | Trigger value | Breach Y/N |

2.2 Pago intereses Series B y C: postergación lugar orden de prelación

Interest payment of Series B & C: place deferred in priority of payments

2.2.1 Serie B / Series B

20.09.2023 g > (50% * B) + C 3.293.162,06 N

2.2.2 Serie C / Series C

20.09.2023 g > (50% * C) 1.150.000,00 N

2.3 Fondo de Reserva:

Cash Reserve:

2.3.1 Condiciones de no reducción

*Conditions Cash Reserve reduction(**)*

- (i) No hayan pasado 3 años desde Constitución Fondo
- (ii) No Nivel Mínimo TODOS Fondos Reserva Fecha Pago anterior *
- (iii) Saldo Vivo Morosos > 1% del Saldo Vivo no Fallidos
- (iv) Prestamos fallidos > 1% del Saldo Vivo no Fallidos

| | | | | |
|------------|-------------------|-------------------|--------|-----|
| 20.09.2023 | 19.06.2009 | años/years < 3.00 | 14,26 | N |
| 20.06.2023 | (n - m) | < 0,00 | 0,00 | N |
| 13.09.2023 | % (b / (a - d)) | ≥ 1,00% | 0,000% | N |
| 13.09.2023 | % ((c+d) / (a-d)) | ≥ 1,00% | 4,054% | S/Y |

3 Amortización Anticipada opcional / Optional Early Amortization

| Fecha datos | Disparador | Condición /Condition | Valor Disparador | Opción Ejercitable S/N |
|-------------|--------------|----------------------|------------------|------------------------|
| Data date | Trigger | Condition /Condition | Trigger value | Exercisable Option Y/N |
| 13.09.2023 | % (a-d) / h) | < 10,00% | 5,15% | S/Y |

(**) No procede reducción si se da alguna de las condiciones / Do not proceed reduction if any condition concurs

(*) Condición Global de todos los cedentes.

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

Actual / Current **20.09.2023**
 Actual / Current **13.09.2023**
 Precedente / Preceding **20.06.2023**
19.06.2009

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

| | | | Fecha datos Data date | Valor / Importe Value / Amount | Cálculo Ratio Ratio calculation | Ratio (valor) Ratio (value) |
|---|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--------------------------------|
| a | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i> | (b + c + d) | | 1.141.150,43 | | |
| b | Saldo Vivo Préstamos Morosos <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans</i> | (>3 y <12 meses) (>3 y <12 meses) | Actual Current 13.09.2023 | 186,10 | % (b / (a - d)) | 0,017% |
| c | Préstamo fallidos <i>Failed Loans</i> | | Actual Current 13.09.2023 | 17.466,76 | % ((c+d) / (a-d)) | 6,039% |
| d | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i> | (≥12 meses) (≥12 months) | Actual Current 13.09.2023 | 48.513,63 | | |
| e | Retención para Amortización de las Series AG, B(CT), C(CT) <i>Series AG, B(CT), C(CT) Amortisation Withholding</i> | | Actual Current 13.09.2023 | 135.478,50 | | |
| f | Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CT), C(CT) <i>Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CT), C(CT)</i> | | Actual Current 13.09.2023 | 135.478,50 | | |
| g | Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i> | | Actual Current 20.09.2023 | 0,00 | | |
| h | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i> | | Initial 19.06.2009 | 47.531.480,66 | | |

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

| | | | | | | |
|---|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|---------------------------------------|--------------|--|--|
| A | Saldo Principal Pendiente Clase AG <i>Outstanding Principal Balance Class A</i> | | Precedente Preceding 20.06.2023 | 0,00 | | |
| B | Saldo Principal Pendiente Serie B (CT) <i>Outstanding Principal Balance Series B(CT)</i> | | Precedente Preceding 20.06.2023 | 0,00 | | |
| C | Saldo Principal Pendiente Serie C (CT) <i>Outstanding Principal Balance Series C(CT)</i> | | Precedente Preceding 20.06.2023 | 1.228.115,40 | | |
| D | Saldo Principal Pendiente Serie D (CT) <i>Outstanding Principal Balance Series D(CT)</i> | | Precedente Preceding 20.06.2023 | 1.020.809,44 | | |
| E | Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CT) y C (CT) <i>Outstanding Principal Balance Series AG, B (CT), C(CT)</i> | | Precedente Preceding 20.06.2023 | 1.228.115,40 | | |

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

| | | | | | | |
|---|------------------------------------------------------------------|--|---------------------------------------|------------|---------|------|
| m | Fondo de Reserva Requerido CT <i>Required Cash Reserve CT</i> | | Precedente Preceding 20.06.2023 | 700.000,00 | | |
| n | Fondo de Reserva dotado CT <i>Provisioned Cash Reserve CT</i> | | Precedente Preceding 20.06.2023 | 700.000,00 | (n - m) | 0,00 |
| o | Fondo de Reserva Requerido CT / <i>Required Cash Reserve CT</i> | | Actual / Currently 20.09.2023 | 700.000,00 | | |
| p | Fondo de Reserva dotado CT / <i>Provisioned Cash Reserve CT</i> | | Actual / Currently 20.09.2023 | 700.000,00 | (p - o) | 0,00 |

2 Situación disparadores / Triggers status

| Fecha datos Data date | Disparador Trigger | Condición Condition | Valor Disparador Trigger value | Actúa S/N Breach Y/N |
|--------------------------|-----------------------|------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
|--------------------------|-----------------------|------------------------|-----------------------------------|-------------------------|

2.2 Pago intereses Series B y C: postergación lugar orden de prelación

Interest payment of Series B & C: place deferred in priority of payments

2.2.1 Serie B / Series B

20.09.2023 g > (50% * B) + C 1.228.115,40 N

2.2.2 Serie C / Series C

20.09.2023 g > (50% * C) 614.057,70 N

2.3 Fondo de Reserva:

Cash Reserve:

2.3.1 Condiciones de no reducción

*Conditions Cash Reserve reduction(**)*

NO PROCEDE POR ESTAR EN EL MINIMO

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 |
|--------------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------|
| 13.09.2023 | % ((a-d) / h) | < 10,00% | 2,30% | S/Y |

(**) No procede reducción si se da alguna de las condiciones / Do not proceed reduction if any condition concurs

(*) Condición Global de todos los cedentes.

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

Actual / Current **20.09.2023**
 Actual / Current **13.09.2023**
 Precedente / Preceding **20.06.2023**
19.06.2009

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

| Fecha datos | Valor / Importe | Cálculo Ratio | Ratio (valor) |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|-------------------|---------------|
| Data date | Value / Amount | Ratio calculation | Ratio (value) |
| a Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i> | (b + c + d) Actual 922.720,28 | | |
| b Saldo Vivo Préstamos Morosos <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans</i> | (>3 y <12 meses) Actual 13.09.2023 0,00 | % (b / (a - d)) | 0,000% |
| c Préstamo fallidos <i>Failed Loans</i> | (>3 y <12 meses) Actual 13.09.2023 28.949,22 | % ((c+d) / (a-d)) | 5,260% |
| d Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i> | (≥12 meses) Actual 13.09.2023 18.610,77 | | |
| e Retención para Amortización de las Series AG, B(CP), C(CP) <i>Series AG, B(CP), C(CP) Amortisation Withholding</i> | Actual 13.09.2023 194.405,70 | | |
| f Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CP), C(CP) <i>Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CP), C(CP)</i> | Actual 13.09.2023 194.405,70 | | |
| g Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i> | Actual 20.09.2023 0,00 | | |
| h Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i> | 19.06.2009 Inicial 55.764.028,90 | | |

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

| | | | |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|--|--|
| A Saldo Principal Pendiente Clase AG <i>Outstanding Principal Balance Class A</i> | Precedente 20.06.2023 0,00 | | |
| B Saldo Principal Pendiente Serie B (CP) <i>Outstanding Principal Balance Series B(CP)</i> | Precedente 20.06.2023 0,00 | | |
| C Saldo Principal Pendiente Serie C (CP) <i>Outstanding Principal Balance Series C(CP)</i> | Precedente 20.06.2023 1.098.515,25 | | |
| D Saldo Principal Pendiente Serie D (CP) <i>Outstanding Principal Balance Series D(CP)</i> | Precedente 20.06.2023 899.208,16 | | |
| E Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CP) y C (CP) <i>Outstanding Principal Balance Series AG, B (CP), C(CP)</i> | Precedente 20.06.2023 1.098.515,25 | | |

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

| | | | |
|--------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|---------|------|
| m Fondo de Reserva Requerido CP <i>Required Cash Reserve CP</i> | Precedente 20.06.2023 800.000,00 | | |
| n Fondo de Reserva dotado CP <i>Provisioned Cash Reserve CP</i> | Precedente 20.06.2023 800.000,00 | (n - m) | 0,00 |
| o Fondo de Reserva Requerido CP / Required Cash Reserve CP | Actual / Currently 20.09.2023 800.000,00 | | |
| p Fondo de Reserva dotado CP / Provisioned Cash Reserve CP | Actual / Currently 20.09.2023 800.000,00 | (p - o) | 0,00 |

2 Situación disparadores / Triggers status

| Fecha datos | Disparador | Condición | Valor Disparador | Actúa S/N |
|-------------|------------|-----------|------------------|------------|
| Data date | Trigger | Condition | Trigger value | Breach Y/N |

2.2 Pago intereses Series B y C: postergación lugar orden de prelación

Interest payment of Series B & C: place deferred in priority of payments

2.2.1 Serie B / Series B

20.09.2023 g > (50% * B) + C 1.098.515,25 N

2.2.2 Serie C / Series C

20.09.2023 g > (50% * C) 549.257,63 N

2.3 Fondo de Reserva:

Cash Reserve:

2.3.1 Condiciones de no reducción

*Conditions Cash Reserve reduction(**)*

NO PROCEDE POR ESTAR EN EL MINIMO

3 Amortización Anticipada opcional / Optional Early Amortization

| Fecha datos | Disparador | Condición /Condition | Valor Disparador | Opción Ejercitable S/N |
|-------------|------------|----------------------|------------------|------------------------|
| Data date | Trigger | Condition /Condition | Trigger value | Exercisable Option Y/N |

13.09.2023 % ((a-d) / h) < 10,00% 1,62% S/Y

(**) No procede reducción si se da alguna de las condiciones / Do not proceed reduction if any condition concurs

(*) Condición Global de todos los cedentes.