

Fecha de Pago / Payment Date	Actual / Current	26.09.2023
Fecha de Determinación / Determination Date	Actual / Current	20.09.2023
Fecha de Pago / Payment Date	Precedente / Preceding	26.06.2023
Fecha constitución Fondo / Fund establishment date		03.04.2006

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 Outstanding Balance Mortgage Loans	(b + c + d)	Actual Currently	73.939.101,88			
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <18 meses) (>3 and <18 months)	Actual Currently	20.09.2023 747.069,95	% (b / e)	1,104%	
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Credits (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses) (≤3 months)	Actual Currently	20.09.2023 66.910.598,64			
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥ 18 meses) (≥18 months)	Actual Currently	20.09.2023 6.281.433,29			
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<18 meses) (<18 months)	Actual Currently	20.09.2023 67.657.668,59	% (e / g)	8,46%	
f	Déficit de Amortización Amortization Deficiency		Actual Currently	20.09.2023 0,00	i - j		
g	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		Inicial Initial	03.04.2006 800.012.981,57			
i	Retención para amortización Amortisation withholding		Actual Currently	26.09.2023 4.064.708,45	F - e		
j	Fondos Disponibles para amortización Available Funds for amortisation		Actual Currently	26.09.2023 4.064.708,45			
1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue							
A	Saldo Principal Pendiente Clase A Outstanding Principal Balance Class A		Precedente Preceding	26.06.2023 59.051.133,20			
A1	Saldo Principal Pendiente Serie A1 Outstanding Principal Balance Series A1		Precedente Preceding	26.06.2023 0,00			
A2	Saldo Principal Pendiente Serie A2 Outstanding Principal Balance Series A2		Precedente Preceding	26.06.2023 59.051.133,20			
B	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B		Precedente Preceding	26.06.2023 2.651.249,04	% (B / F)	3,697%	
C	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C		Precedente Preceding	26.06.2023 2.819.994,80	% (C / F)	3,932%	
D	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D		Precedente Preceding	26.06.2023 7.200.000,00	% (D / F)	10,039%	
E	Saldo Principal Pendiente Serie E Outstanding Principal Balance Series E		Precedente Preceding	26.06.2023 10.000.000,00			
F	Saldo Principal Pendiente Series A1, A2, B, C y D Outstanding Principal Balance Series A1, A2, B, C and D		Precedente Preceding	26.06.2023 71.722.377,04			
G	Importe Nominal Emisión de Series A1, A2, B, C y D Issue face amount of Series A1, A2, B, C and D		Inicial Initial	03.04.2006 800.000.000,00			
1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve							
l	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Precedente / Preceding	26.06.2023 10.000.000,00			
m	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve		Precedente / Preceding	26.06.2023 10.000.000,00	(m - l)	0,00	
n	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Actual / Currently	26.09.2023 10.000.000,00			
o	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve		Actual / Currently	26.09.2023 10.000.000,00	(o - n)	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 / Series B			20.09.2023	f	> (0,85*B)+(C+D)	12.273.556,48	N
2.1.2 Serie C / Series C			20.09.2023	f	> (0,85*C)+ D	9.596.995,58	N
2.1.3 Serie D / Series D			20.09.2023	f	> 0,85*D	6.120.000,00	N
2.2 Amortización a Prorrata Series B, C y D Pro Rata Amortisation of Series B, C & D							
2.2.0 Condiciones comunes / Common conditions (*)							
(i) Dotación Fondo Reserva			26.06.2023	(m - l)	= 0,00	0,00	S/Y
(ii) SV no dudoso sobre Saldo inicial constitución			20.09.2023	% (e / g)	≥ 10,00%	8,46%	N
2.2.1 Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (*)							
(i) % Serie B sobre total bonos			20.09.2023	% (B / F)	≥ 3,300%	3,697%	S/Y
(ii) Morosos / SV no dudoso			20.09.2023	% (b / e)	≤ 1,50%	1,104%	S/Y
2.2.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (*)							
(i) % Serie C sobre total bonos			20.09.2023	% (C / F)	≥ 2,900%	3,932%	S/Y
(ii) Morosos / SV no dudoso			20.09.2023	% (b / e)	≤ 1,25%	1,104%	S/Y
2.2.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (*)							
(i) % Serie D sobre total bonos			20.09.2023	% (D / F)	≥ 1,800%	10,039%	S/Y
(ii) Morosos / SV no dudoso			20.09.2023	% (b / e)	≤ 1,00%	1,104%	N
2.3 Fondo de Reserva: Cash Reserve							
2.3.1 Condiciones de reducción Cash Reserve reduction:							
2.3.2 Condiciones de no reducción (solo aplica si 2.3.1 es S/Y) (**) Cash Reserve no reduction (**)			26.09.2023	% G- (G-e)	> 2,50%	14,78%	S/Y
(i) Morosos / Saldo Vivo no dudoso			20.09.2023	% (b / e)	> 1,00%	1,104%	S/Y
(ii) No se pudiera dotar el Fondo Reserva Requerido en FP anterior			26.06.2023	(m - l)	< 0,00	0,00	N
(iii) Margen medio Indices Ref por Ppal Pte ≤ 0,60%			20.09.2023	g	≤ 0,600%	0,932525%	N
(iv) No hayan pasado 3 años desde Constitución Fondo			26.09.2023	03.04.2006	años/years < 3,00	17,49	N

(*) Deben darse todas las condiciones / All conditions must concur

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

3 Amortización Anticipada opcional / Optional Early Amortization			Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Opción ejercitable S/N Exercitable option Y/N
			20.09.2023	% (a / g)	< 10,00%	9,24%	S/Y