

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

Actual / Current **19.09.2023**
 Actual / Current **13.09.2023**
 Precedente / Preceding **19.06.2023**
19.02.2007

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 Outstanding Balance Mortgage Loans	(b + c + d)		551.904.500,46		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <12 meses) (>3 and <12 months)	13.09.2023	1.155.347,56	% (b / e)	0,215%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(≤3 meses) (≤3 months)	13.09.2023	536.944.271,92		
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥12 meses) (≥12 months)	13.09.2023	13.804.880,98		
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<12 meses) (<12 months)	13.09.2023	538.099.619,48	% (e / g)	21,52%
f	Saldo Vivo acumulado Préstamos Hipotecarios Dudosos Cumulative Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans		13.09.2023	162.040.393,14	% (f / g)	6,48%
g	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		19.02.2007	2.500.000.049,34		
h	Ingresos Principal Préstamos Hipotecarios en Periodo Determinación Mortgage Loan principal income during Determination Period		13.09.2023	21.255.070,72		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase A Outstanding Principal Balance Mortgage Class A		Precedente Preceding	19.06.2023	467.803.957,50	
A1	Saldo Principal Pendiente Serie A1 Outstanding Principal Balance Series A1		Precedente Preceding	19.06.2023	0,00	
A2	Saldo Principal Pendiente Serie A2 Outstanding Principal Balance Series A2		Precedente Preceding	19.06.2023	0,00	
A3	Saldo Principal Pendiente Serie A3 Outstanding Principal Balance Series A3		Precedente Preceding	19.06.2023	467.803.957,50	
B	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B		Precedente Preceding	19.06.2023	53.719.116,00	% (B / D)
C	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C		Precedente Preceding	19.06.2023	38.051.040,50	% (C / D)
D	Saldo Principal Pendiente Emisión Bonos Outstanding Principal Balance Bond Issue		Precedente Preceding	19.06.2023	559.574.114,00	

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

i	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Precedente / Preceding	19.06.2023	22.500.000,00	
k	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve		Precedente / Preceding	19.06.2023	22.500.000,00	(k - j)
l	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Actual / Current	19.09.2023	22.500.000,00	
m	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve		Actual / Current	19.09.2023	22.500.000,00	(m - l)

2 Situación disparadores / Triggers status
2.1 Amortización a prorrata Clase A / Pro rata amortisation Class A

Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Actúa S/N Breach Y/N
13.09.2023	(c + h) / A	≤ 1,00	1,193	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	13.09.2023	% (f / g)	> 12,50%	6,48%	N
2.2.2 Serie C / Series C	13.09.2023	% (f / g)	> 10,00%	6,48%	N

2.3 Amortización a Prorrata Series B/C

Pro Rata Amortisation of Series B/C

2.3.0 Condiciones comunes / Common conditions (*)

(i) Fondo Reserva dotado	19.09.2023	(m - l)	= 0,00	0,00	S/Y
(ii) SV no dudoso / saldo inicial de fondo	13.09.2023	% (e / g)	≥ 10,00%	21,52%	S/Y
(iii) No amort a prorrata Clase A	13.09.2023		= N		S/Y

2.3.1 Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (*)

(i) % Serie B sobre total bonos	13.09.2023	% (B / D)	≥ 9,600%	9,600%	S/Y
(ii) Morosos / SV no dudoso	13.09.2023	% (b / e)	≤ 1,25%	0,215%	S/Y

2.3.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (*)

(i) % Serie C sobre total bonos	13.09.2023	% (C / D)	≥ 6,800%	6,800%	S/Y
(ii) Morosos / SV no dudoso	13.09.2023	% (b / e)	≤ 1,00%	0,215%	S/Y

**2.4 Fondo de Reserva:
Cash Reserve**

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 / g)	< 10,00%	22,08%	N