

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

Actual / Current **17.08.2021**
 Actual / Current **10.08.2021**
 Precedente / Preceding **17.05.2021**
 Precedente / Preceding **28.03.2007**

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 <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>	(b + c + d)	Actual Currently	10.08.2021	309.833.690,48	
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>	(>3 y <18 meses)	Actual Currently	10.08.2021	4.728.915,42	% (b / e) 1,582%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>	(≤ 3 meses)	Actual Currently	10.08.2021	294.248.682,15	
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	(≥ 18 meses)	Actual Currently	10.08.2021	10.856.092,91	
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos <i>Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans</i>	(<18 meses)	Actual Currently	10.08.2021	298.977.597,57	% (e / f) 19,93%
f	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>		Inicial Initial	28.03.2007	1.500.118.980,94	
g	Retención para Amortización de las Series A, B, C y D <i>Series A, B, C & D Amortization Withholding</i>	(F - e)	Actual Currently	17.08.2021	10.630.373,26	
h	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A, B, C y D <i>Available Funds applied for Amortization of Series A, B, C & D</i>		Actual Currently	17.08.2021	10.630.373,26	
i	Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i>		Actual Currently	17.08.2021	0,00	
j	Saldo Vivo Acumulado de los Préstamos Dudosos <i>Accumulated Outstanding Balance of Doubtful Loans</i>		Actual Currently	10.08.2021	79.204.992,89	
k	Ingresos percibidos por reembolso de principal <i>Income received from repayment of principal</i>		Actual Currently	10.08.2021	12.638.654,39	

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Serie A <i>Outstanding Principal Balance Series A</i>		Precedente Preceding	17.05.2021	276.202.379,71	
B	Saldo Principal Pendiente Serie B <i>Outstanding Principal Balance Series B</i>		Precedente Preceding	17.05.2021	13.836.936,72	% (B / F) 4,469%
C	Saldo Principal Pendiente Serie C <i>Outstanding Principal Balance Series C</i>		Precedente Preceding	17.05.2021	13.838.100,90	% (C / F) 4,470%
D	Saldo Principal Pendiente Serie D <i>Outstanding Principal Balance Series D</i>		Precedente Preceding	17.05.2021	5.730.553,50	% (D / F) 1,851%
E	Saldo Principal Pendiente Serie E <i>Outstanding Principal Balance Series E</i>		Precedente Preceding	17.05.2021	7.500.000,00	
F	Saldo Principal Pendiente Series A, B, C y D. <i>Outstanding Principal Balance Series A, B, C & D.</i>		Precedente Preceding	17.05.2021	309.607.970,83	
G	Importe nominal emisión Serie A <i>Issue face amount Series A</i>		Inicial Initial	28.03.2007	1.431.700.000,00	
H	Importe nominal emisión Serie B <i>Issue face amount Series B</i>		Inicial Initial	28.03.2007	29.300.000,00	
I	Importe nominal emisión Serie C <i>Issue face amount Series C</i>		Inicial Initial	28.03.2007	28.500.000,00	
J	Importe nominal emisión Serie D <i>Issue face amount Series D</i>		Inicial Initial	28.03.2007	10.500.000,00	

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

l	Fondo de Reserva Requerido / <i>Required Cash Reserve</i>		Precedente / Preceding	17.05.2021	7.500.000,00	
m	Fondo de Reserva Dotado / <i>Provisioned Cash Reserve</i>		Precedente / Preceding		7.359.932,56	
n	Fondo de Reserva Requerido / <i>Required Cash Reserve</i>		Actual / Currently	17.08.2021	7.500.000,00	
ñ	Fondo de Reserva Dotado / <i>Provisioned Cash Reserve</i>		Actual / Currently		7.500.000,00	

2 Situación disparadores / Triggers status

	Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Actúa S/N Breach Y/N
2.1 Pago intereses Series B, C y D: postergación lugar orden de prelación <i>Interest payment of Series B, C & D: place deferred in priority of payments</i>					
2.1.1	10.08.2021	Serie B / Series B	Saldo Vivo Ptmos Dudosos	(i/f) > 8,00%	5,28% N
2.1.2	10.08.2021	Serie C / Series C	Saldo Vivo Ptmos Dudosos	(i/f) > 5,20%	5,28% S/Y
2.1.3	10.08.2021	Serie D / Series D	Saldo Vivo Ptmos Dudosos	(i/f) > 4,50%	5,28% S/Y
2.2 Fondo de Reserva: <i>Cash Reserve</i> NO APLICA POR ESTAR EN EL MÍNIMO					
2.3	10.08.2021	Amortización a Prorrata Clase A	(c+k)/A	< 1,00%	1,11 N
2.4	Amortización a Prorrata Series B, C y D <i>Pro Rata Amortisation of Series B, C & D</i>				
2.4.0 Condiciones comunes / Common conditions (**)					
(i)	10.08.2021	No procede 2.3	N		S/Y
(ii)	17.08.2021	Fondo de Reserva en F.P. = Fondo de Reserva requerido	= 0,00	0,00	S/Y
(iii)	10.08.2021	Saldo Vivo Ph's no Dudosos > 10% Aldo Vivo inicial	≥ 10,00%	19,93%	S/Y
2.4.1 Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (**)					
(i)	10.08.2021	el Saldo de Principal Pendiente de la Serie B sea igual o mayor al 3,907%	≥ 3,907%	4,469%	S/Y
(ii)	10.08.2021	el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,25%	≤ 1,25%	1,582%	N
2.4.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (**)					
(i)	10.08.2021	el Saldo de Principal Pendiente de la Serie C sea igual o mayor al 3,800%	≥ 3,800%	4,470%	S/Y
(ii)	10.08.2021	el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,00%	≤ 1,00%	1,582%	N
2.4.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (**)					
(i)	10.08.2021	el Saldo de Principal Pendiente de la Serie D sea igual o mayor al 1,400% de la suma del	≥ 1,400%	1,851%	N
(ii)	10.08.2021	el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 0,75%	≤ 0,75%	1,582%	N

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

(**) Procede la reducción si se dan todas las condiciones

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
28/03/2007	% (a / g)	< 10,00%	20,65%	N