

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: 202100002
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION, S.A., SGFT
NIF Gestora: A88248166
Fondo Abierto: SI
Fondo Privado: SI
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2023

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: 202100002 |
| Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT |
| Estados agregados: NO |
| Fecha: 31/03/2023 |

| BALANCE (miles de euros) | | Periodo actual 31/03/2023 | | Periodo anterior 31/12/2022 |
|---|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| 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 | 0 | 1004 | 0 |
| 1.2 Certificados de transmisión hipotecaria | 0005 | 0 | 1005 | 0 |
| 1.3 Préstamos hipotecarios | 0006 | 0 | 1006 | 0 |
| 1.4 Cédulas hipotecarias | 0007 | 0 | 1007 | 0 |
| 1.5 Préstamos a promotores | 0008 | 0 | 1008 | 0 |
| 1.6 Préstamos a PYMES | 0009 | 0 | 1009 | 0 |
| 1.7 Préstamos a empresas | 0010 | 0 | 1010 | 0 |
| 1.8 Préstamos corporativos | 0011 | 0 | 1011 | 0 |
| 1.9 Cédulas territoriales | 0012 | 0 | 1012 | 0 |
| 1.10 Bonos de tesorería | 0013 | 0 | 1013 | 0 |
| 1.11 Deuda subordinada | 0014 | 0 | 1014 | 0 |
| 1.12 Créditos AAPP | 0015 | 0 | 1015 | 0 |
| 1.13 Préstamos consumo | 0016 | 0 | 1016 | 0 |
| 1.14 Préstamos automoción | 0017 | 0 | 1017 | 0 |
| 1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing) | 0018 | 0 | 1018 | 0 |
| 1.16 Cuentas a cobrar | 0019 | 0 | 1019 | 0 |
| 1.17 Derechos de crédito futuros | 0020 | 0 | 1020 | 0 |
| 1.18 Bonos de titulación | 0021 | 0 | 1021 | 0 |
| 1.19 Cédulas internacionalización | 0022 | 0 | 1022 | 0 |
| 1.20 Otros | 0023 | 0 | 1023 | 0 |
| 1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos | 0024 | 0 | 1024 | 0 |
| 1.22 Activos dudosos -principal- | 0025 | 0 | 1025 | 0 |
| 1.23 Activos dudosos -intereses y otros- | 0026 | 0 | 1026 | 0 |
| 1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-) | 0027 | 0 | 1027 | 0 |
| 1.25 Ajustes por operaciones de cobertura | 0028 | 0 | 1028 | 0 |
| 2. Derivados | 0029 | | 1029 | |
| 2.1 Derivados de cobertura | 0030 | 0 | 1030 | 0 |
| 2.2 Derivados de negociación | 0031 | 0 | 1031 | 0 |
| 3. Otros activos financieros | 0032 | | 1032 | |
| 3.1 Valores representativos de deuda | 0033 | 0 | 1033 | 0 |
| 3.2 Instrumentos de patrimonio | 0034 | 0 | 1034 | 0 |
| 3.3 Garantías financieras | 0035 | 0 | 1035 | 0 |
| 3.4 Otros | 0036 | 0 | 1036 | 0 |
| 3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-) | 0037 | 0 | 1037 | 0 |
| Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía | 0038 | 0 | 1038 | 0 |
| II. Activos por impuesto diferido | 0039 | 0 | 1039 | 0 |
| III. Otros activos no corrientes | 0040 | 0 | 1040 | 0 |

S.01

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

| BALANCE (miles de euros) | | Periodo actual 31/03/2023 | | Periodo anterior 31/12/2022 |
|--|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| B) ACTIVO CORRIENTE | 0041 | 2.815 | 1041 | 23.898 |
| IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta | 0042 | 0 | 1042 | 0 |
| V. Activos financieros a corto plazo | 0043 | 2.781 | 1043 | 23.886 |
| 1. Activos titulizados | 0044 | 2.779 | 1044 | 23.885 |
| 1.1 Participaciones hipotecarias | 0045 | 0 | 1045 | 0 |
| 1.2 Certificados de transmisión hipotecaria | 0046 | 0 | 1046 | 0 |
| 1.3 Préstamos hipotecarios | 0047 | 0 | 1047 | 0 |
| 1.4 Cédulas hipotecarias | 0048 | 0 | 1048 | 0 |
| 1.5 Préstamos a promotores | 0049 | 0 | 1049 | 0 |
| 1.6 Préstamos a PYMES | 0050 | 0 | 1050 | 0 |
| 1.7 Préstamos a empresas | 0051 | 0 | 1051 | 0 |
| 1.8 Préstamos corporativos | 0052 | 0 | 1052 | 0 |
| 1.9 Cédulas territoriales | 0053 | 0 | 1053 | 0 |
| 1.10 Bonos de tesorería | 0054 | 0 | 1054 | 0 |
| 1.11 Deuda subordinada | 0055 | 0 | 1055 | 0 |
| 1.12 Créditos AAPP | 0056 | 0 | 1056 | 0 |
| 1.13 Préstamos consumo | 0057 | 0 | 1057 | 0 |
| 1.14 Préstamos automoción | 0058 | 0 | 1058 | 0 |
| 1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing) | 0059 | 0 | 1059 | 0 |
| 1.16 Cuentas a cobrar | 0060 | 2.779 | 1060 | 23.855 |
| 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 | 0 | 1065 | 30 |
| 1.22 Intereses vencidos e impagados | 0066 | 0 | 1066 | 0 |
| 1.23 Activos dudosos -principal- | 0067 | 0 | 1067 | 0 |
| 1.24 Activos dudosos -intereses- | 0068 | 0 | 1068 | 0 |
| 1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-) | 0069 | 0 | 1069 | 0 |
| 1.26 Ajustes por operaciones de cobertura | 0070 | 0 | 1070 | 0 |
| 2. Derivados | 0071 | | 1071 | |
| 2.1 Derivados de cobertura | 0072 | 0 | 1072 | 0 |
| 2.2 Derivados de negociación | 0073 | 0 | 1073 | 0 |
| 3. Otros activos financieros | 0074 | 1 | 1074 | 1 |
| 3.1 Valores representativos de deuda | 0075 | 0 | 1075 | 0 |
| 3.2 Instrumentos de patrimonio | 0076 | 0 | 1076 | 0 |
| 3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar | 0077 | 1 | 1077 | 1 |
| 3.4 Garantías financieras | 0078 | 0 | 1078 | 0 |
| 3.5 Otros | 0079 | 0 | 1079 | 0 |
| 3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-) | 0080 | 0 | 1080 | 0 |
| Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía | 0081 | 0 | 1081 | 0 |
| VI. Ajustes por periodificaciones | 0082 | | 1082 | |
| 1. Comisiones | 0083 | 0 | 1083 | 0 |
| 2. Otros | 0084 | 0 | 1084 | 0 |
| VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes | 0085 | 34 | 1085 | 12 |
| 1. Tesorería | 0086 | 34 | 1086 | 12 |
| 2. Otros activos líquidos equivalentes | 0087 | 0 | 1087 | 0 |
| TOTAL ACTIVO | 0088 | 2.815 | 1088 | 23.898 |

S.01

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

| BALANCE (miles de euros) | | Periodo actual 31/03/2023 | | Periodo anterior 31/12/2022 |
|---|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| PASIVO | | | | |
| A) PASIVO NO CORRIENTE | 0089 | | 1089 | |
| I. Provisiones a largo plazo | 0090 | | 1090 | |
| 1. Provisión garantías financieras | 0091 | 0 | 1091 | 0 |
| 2. Provisión por margen de intermediación | 0092 | 0 | 1092 | 0 |
| 3. Otras provisiones | 0093 | 0 | 1093 | 0 |
| II. Pasivos financieros a largo plazo | 0094 | | 1094 | |
| 1. Obligaciones y otros valores emitidos | 0095 | | 1095 | |
| 1.1 Series no subordinadas | 0096 | 0 | 1096 | 0 |
| 1.2 Series subordinadas | 0097 | 0 | 1097 | 0 |
| 1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0098 | 0 | 1098 | 0 |
| 1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos | 0099 | 0 | 1099 | 0 |
| 1.5 Ajustes por operaciones de cobertura | 0100 | 0 | 1100 | 0 |
| 2. Deudas con entidades de crédito | 0101 | | 1101 | |
| 2.1 Préstamo subordinado | 0102 | 0 | 1102 | 0 |
| 2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta | 0103 | 0 | 1103 | 0 |
| 2.3 Otras deudas con entidades de crédito | 0104 | 0 | 1104 | 0 |
| 2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0105 | 0 | 1105 | 0 |
| 2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos | 0106 | 0 | 1106 | 0 |
| 2.6 Ajustes por operaciones de cobertura | 0107 | 0 | 1107 | 0 |
| 3. Derivados | 0108 | | 1108 | |
| 3.1 Derivados de cobertura | 0109 | 0 | 1109 | 0 |
| 3.2 Derivados de negociación | 0110 | 0 | 1110 | 0 |
| 3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0111 | 0 | 1111 | 0 |
| 4. Otros pasivos financieros | 0112 | | 1112 | |
| 4.1 Garantías financieras | 0113 | 0 | 1113 | 0 |
| 4.1 Otros | 0114 | 0 | 1114 | 0 |
| 4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0115 | 0 | 1115 | 0 |
| III. Pasivos por impuesto diferido | 0116 | 0 | 1116 | 0 |

S.01

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

| BALANCE (miles de euros) | | Periodo actual 31/03/2023 | | Periodo anterior 31/12/2022 |
|--|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| B) PASIVO CORRIENTE | 0117 | 2.815 | 1117 | 23.898 |
| IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta | 0118 | 0 | 1118 | 0 |
| V. Provisiones a corto plazo | 0119 | | 1119 | |
| 1. Provisión garantías financieras | 0120 | 0 | 1120 | 0 |
| 2. Provisión por margen de intermediación | 0121 | 0 | 1121 | 0 |
| 3. Otras provisiones | 0122 | 0 | 1122 | 0 |
| VI. Pasivos financieros a corto plazo | 0123 | 2.779 | 1123 | 23.870 |
| 1. Obligaciones y otros valores emitidos | 0124 | 2.779 | 1124 | 23.870 |
| 1.1 Series no subordinadas | 0125 | 2.779 | 1125 | 23.855 |
| 1.2 Series subordinadas | 0126 | 0 | 1126 | 0 |
| 1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0127 | 0 | 1127 | 0 |
| 1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos | 0128 | 0 | 1128 | 15 |
| 1.5 Intereses vencidos e impagados | 0129 | 0 | 1129 | 0 |
| 1.6 Ajustes por operaciones de cobertura | 0130 | 0 | 1130 | 0 |
| 2. Deudas con entidades de crédito | 0131 | | 1131 | |
| 2.1 Préstamo subordinado | 0132 | 0 | 1132 | 0 |
| 2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta | 0133 | 0 | 1133 | 0 |
| 2.3 Otras deudas con entidades de crédito | 0134 | 0 | 1134 | 0 |
| 2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0135 | 0 | 1135 | 0 |
| 2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos | 0136 | 0 | 1136 | 0 |
| 2.6 Intereses vencidos e impagados | 0137 | 0 | 1137 | 0 |
| 2.7 Ajustes por operaciones de cobertura | 0138 | 0 | 1138 | 0 |
| 3. Derivados | 0139 | | 1139 | |
| 3.1 Derivados de cobertura | 0140 | 0 | 1140 | 0 |
| 3.2 Derivados de negociación | 0141 | 0 | 1141 | 0 |
| 3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0142 | 0 | 1142 | 0 |
| 4. Otros pasivos financieros | 0143 | | 1143 | |
| 4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar | 0144 | 0 | 1144 | 0 |
| 4.2 Garantías financieras | 0145 | 0 | 1145 | 0 |
| 4.3 Otros | 0146 | 0 | 1146 | 0 |
| 4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0147 | 0 | 1147 | 0 |
| VII. Ajustes por periodificaciones | 0148 | 36 | 1148 | 28 |
| 1. Comisiones | 0149 | 30 | 1149 | 23 |
| 1.1 Comisión sociedad gestora | 0150 | 10 | 1150 | 2 |
| 1.2 Comisión administrador | 0151 | 5 | 1151 | 6 |
| 1.3 Comisión agente financiero/pagos | 0152 | 0 | 1152 | 0 |
| 1.4 Comisión variable | 0153 | 15 | 1153 | 14 |
| 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 | 0 | 1156 | 1 |
| 2. Otros | 0157 | 5 | 1157 | 5 |
| C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS | 0158 | | 1158 | |
| VIII. Activos financieros disponibles para la venta | 0159 | 0 | 1159 | 0 |
| IX. Coberturas de flujos de efectivo | 0160 | 0 | 1160 | 0 |
| X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos | 0161 | 0 | 1161 | 0 |
| TOTAL PASIVO | 0162 | 2.815 | 1162 | 23.898 |

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

| CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros) | | P. corriente actual (1. trimestre) | | P. corriente anterior (1. trimestre) | | Acumulado actual 31/03/2023 | | Acumulado anterior 31/03/2022 |
|--|------|------------------------------------|------|--------------------------------------|------|-----------------------------|------|-------------------------------|
| 1. Intereses y rendimientos asimilados | 0201 | 80 | 1201 | 102 | 2201 | 80 | 3201 | 102 |
| 1.1 Activos titulizados | 0202 | 80 | 1202 | 102 | 2202 | 80 | 3202 | 102 |
| 1.2 Otros activos financieros | 0203 | 0 | 1203 | | 2203 | 0 | 3203 | |
| 2. Intereses y cargas asimilados | 0204 | -40 | 1204 | -53 | 2204 | -40 | 3204 | -53 |
| 2.1 Obligaciones y otros valores emitidos | 0205 | -40 | 1205 | -53 | 2205 | -40 | 3205 | -53 |
| 2.2 Deudas con entidades de crédito | 0206 | 0 | 1206 | 0 | 2206 | 0 | 3206 | 0 |
| 2.3 Otros pasivos financieros | 0207 | 0 | 1207 | 0 | 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 | 40 | 1209 | 49 | 2209 | 40 | 3209 | 49 |
| 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 | -1 | 1215 | -1 | 2215 | -1 | 3215 | -1 |
| 6. Otros ingresos de explotación | 0216 | 0 | 1216 | | 2216 | 0 | 3216 | |
| 7. Otros gastos de explotación | 0217 | -38 | 1217 | -49 | 2217 | -38 | 3217 | -49 |
| 7.1 Servicios exteriores | 0218 | 0 | 1218 | -2 | 2218 | 0 | 3218 | -2 |
| 7.1.1 Servicios de profesionales independientes | 0219 | 0 | 1219 | -1 | 2219 | 0 | 3219 | -1 |
| 7.1.2 Servicios bancarios y similares | 0220 | 0 | 1220 | -1 | 2220 | 0 | 3220 | -1 |
| 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 | -38 | 1224 | -47 | 2224 | -38 | 3224 | -47 |
| 7.3.1 Comisión sociedad gestora | 0225 | -9 | 1225 | -9 | 2225 | -9 | 3225 | -9 |
| 7.3.2 Comisión administrador | 0226 | -24 | 1226 | -17 | 2226 | -24 | 3226 | -17 |
| 7.3.3 Comisión agente financiero/pagos | 0227 | 0 | 1227 | 0 | 2227 | 0 | 3227 | 0 |
| 7.3.4 Comisión variable | 0228 | 0 | 1228 | -20 | 2228 | 0 | 3228 | -20 |
| 7.3.5 Otras comisiones del cedente | 0229 | 0 | 1229 | 0 | 2229 | 0 | 3229 | 0 |
| 7.3.6 Otros gastos | 0230 | -4 | 1230 | | 2230 | -4 | 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 | 0 | 1239 | 0 | 2239 | 0 | 3239 | 0 |
| B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS | 0240 | | 1240 | | 2240 | | 3240 | |
| 12. Impuesto sobre beneficios | 0241 | 0 | 1241 | | 2241 | 0 | 3241 | |
| C) RESULTADO DEL PERIODO | 0242 | 0 | 1242 | 0 | 2242 | 0 | 3242 | 0 |

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

| ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros) | | P. corriente actual (1. trimestre) | | P. corriente anterior (1. trimestre) | | Acumulado actual 31/03/2023 | | Acumulado anterior 31/03/2022 |
|--|------|------------------------------------|------|--------------------------------------|------|-----------------------------|------|-------------------------------|
| A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION | 0300 | 28 | 1300 | 10 | 2300 | 28 | 3300 | 10 |
| 1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones | 0301 | 65 | 1301 | 13 | 2301 | 65 | 3301 | 13 |
| 1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados | 0302 | 109 | 1302 | 30 | 2302 | 109 | 3302 | 30 |
| 1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos | 0303 | -44 | 1303 | -17 | 2303 | -44 | 3303 | -17 |
| 1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura | 0304 | 0 | 1304 | | 2304 | 0 | 3304 | 0 |
| 1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura | 0305 | 0 | 1305 | | 2305 | 0 | 3305 | 0 |
| 1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros | 0306 | 0 | 1306 | | 2306 | 0 | 3306 | 0 |
| 1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito | 0307 | 0 | 1307 | 0 | 2307 | 0 | 3307 | 0 |
| 1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto) | 0308 | 0 | 1308 | 0 | 2308 | 0 | 3308 | 0 |
| 2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados | 0309 | -38 | 1309 | -3 | 2309 | -38 | 3309 | -3 |
| 2.1 Comisión sociedad gestora | 0310 | -9 | 1310 | -1 | 2310 | -9 | 3310 | -1 |
| 2.2 Comisión administrador | 0311 | -24 | 1311 | -1 | 2311 | -24 | 3311 | -1 |
| 2.3 Comisión agente financiero/pagos | 0312 | 0 | 1312 | -1 | 2312 | 0 | 3312 | -1 |
| 2.4 Comisión variable | 0313 | 0 | 1313 | 0 | 2313 | 0 | 3313 | 0 |
| 2.5 Otras comisiones | 0314 | -4 | 1314 | 0 | 2314 | -4 | 3314 | 0 |
| 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 | 0 |
| 3.2 Cobros por garantías financieras | 0317 | 0 | 1317 | | 2317 | 0 | 3317 | 0 |
| 3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación | 0318 | 0 | 1318 | | 2318 | 0 | 3318 | 0 |
| 3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación | 0319 | 0 | 1319 | | 2319 | 0 | 3319 | 0 |
| 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 | -5 | 1322 | 0 | 2322 | -5 | 3322 | 0 |
| 4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización | 0323 | 2.779 | 1323 | 82.739 | 2323 | 2.779 | 3323 | 82.739 |
| 5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros | 0324 | -2.779 | 1324 | -82.739 | 2324 | -2.779 | 3324 | -82.739 |
| 6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos | 0325 | -43 | 1325 | -12 | 2325 | -43 | 3325 | -12 |
| 6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados | 0326 | 23.610 | 1326 | 2.850 | 2326 | 23.610 | 3326 | 2.850 |
| 6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados | 0327 | 0 | 1327 | | 2327 | 0 | 3327 | 0 |
| 6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados | 0328 | 0 | 1328 | | 2328 | 0 | 3328 | 0 |
| 6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos | 0329 | 0 | 1329 | | 2329 | 0 | 3329 | 0 |
| 6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías | 0330 | 0 | 1330 | | 2330 | 0 | 3330 | 0 |
| 6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos | 0331 | -23.654 | 1331 | -2.861 | 2331 | -23.654 | 3331 | -2.861 |
| 7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo | 0332 | 38 | 1332 | 12 | 2332 | 38 | 3332 | 12 |
| 7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito | 0333 | 0 | 1333 | 0 | 2333 | 0 | 3333 | 0 |
| 7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito | 0334 | 0 | 1334 | | 2334 | 0 | 3334 | 0 |
| 7.3 Pagos a Administraciones públicas | 0335 | 0 | 1335 | 0 | 2335 | 0 | 3335 | 0 |
| 7.4 Otros cobros y pagos | 0336 | 38 | 1336 | 12 | 2336 | 38 | 3336 | 12 |
| C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES | 0337 | 23 | 1337 | 10 | 2337 | 23 | 3337 | 10 |
| Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo | 0338 | 12 | 1338 | 8 | 2338 | 12 | 3338 | 8 |
| Efectivo o equivalentes al final del periodo | 0339 | 34 | 1339 | 18 | 2339 | 34 | 3339 | 18 |

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

| INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros) | | P. corriente actual (1. trimestre) | | P. corriente anterior (1. trimestre) | | Acumulado actual 31/03/2023 | | Acumulado anterior 31/03/2022 |
|--|-------------|------------------------------------|-------------|--------------------------------------|-------------|-----------------------------|-------------|-------------------------------|
| 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: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

| Ratios (%) | Situación actual 31/03/2023 | | | | | | | | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | | | | | | | | 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: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

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: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

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 31/03/2023 | | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | | Situación inicial 19/01/2021 | |
| Inferior a 1 año | 0600 | 2.779 | 1600 | 23.855 | 2600 | 227.135 |
| 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 | 2.779 | 1607 | 23.855 | 2607 | 227.135 |
| Vida residual media ponderada (años) | 0608 | 0,10 | 1608 | 0,11 | 2608 | 0,19 |

| Antigüedad | Principal pendiente | | | | | |
|-----------------------------------|-----------------------------|------|--|------|------------------------------|------|
| | Situación actual 31/03/2023 | | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | | Situación inicial 19/01/2021 | |
| Antigüedad media ponderada (años) | 0609 | 0,02 | 1609 | 0,08 | 2609 | 0,07 |

S.05.1

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

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 31/03/2023 | | | | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | | | | 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: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

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 31/03/2023 | | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | | Situación inicial 19/01/2021 | |
|---|--------------------------------|------|---|------|------------------------------|------|
| | | | | | | |
| Tipo de interés medio ponderado | 0650 | 3,50 | 1650 | 3,00 | 2650 | 3,03 |
| Tipo de interés nominal máximo | 0651 | 3,50 | 1651 | 3,00 | 2651 | 3,50 |
| Tipo de interés nominal mínimo | 0652 | 3,50 | 1652 | 3,00 | 2652 | 3,00 |

S.05.1

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

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 31/03/2023 | | | | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | | | | 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 | 15 | 0695 | 2.779 | 1672 | 43 | 1695 | 23.855 | 2672 | 625 | 2695 | 227.135 |
| 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 | 15 | 0702 | 2.779 | 1679 | 43 | 1702 | 23.855 | 2679 | 625 | 2702 | 227.135 |
| Otros países Unión Europea | 0680 | | 0703 | | 1680 | | 1703 | | 2680 | | 2703 | |
| Resto | 0681 | | 0704 | | 1681 | | 1704 | | 2681 | | 2704 | |
| Total general | 0682 | 15 | 0705 | 2.779 | 1682 | 43 | 1705 | 23.855 | 2682 | 625 | 2705 | 227.135 |

| |
|--|
| S.05.1 |
| Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT |
| Denominación del compartimento: 202100002 |
| Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT |
| Estados agregados: NO |
| Fecha: 31/03/2023 |
| Entidades cedentes de los activos titulizados: ZEPA FINANCE, S.L. |

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

| Concentración | Situación actual 31/03/2023 | | | | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | | | | Situación inicial 19/01/2021 | | | |
|---|-----------------------------|--------|------|-------|--|--------|------|-------|------------------------------|-------|------|-------|
| | Porcentaje | | CNAE | | Porcentaje | | CNAE | | Porcentaje | | CNAE | |
| Diez primeros deudores/emisores con más concentración | 0710 | 100,00 | | | 1710 | 100,00 | | | 2710 | 99,95 | | |
| Sector | 0711 | 66,62 | 0712 | 9.499 | 1711 | 81,38 | 1712 | 9.499 | 2711 | 70,60 | 2712 | 7.112 |

S.05.2

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

| (miles de euros) | | Situación actual 31/03/2023 | | | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | | | 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 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.622.879 | 1.616 |
| | PAGARE 2 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.179.874 | 1.175 |
| | PAGARE 3 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 405.752 | 404 |
| | PAGARE 4 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 461.362 | 459 |
| | PAGARE 5 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 201.747 | 201 |
| | PAGARE 6 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 257.053 | 256 |
| | PAGARE 7 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 997.923 | 992 |
| | PAGARE 8 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 826.033 | 822 |
| | PAGARE 9 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 411.831 | 410 |
| | PAGARE 10 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 776.443 | 772 |
| | PAGARE 11 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 920.989 | 916 |
| | PAGARE 12 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 806.275 | 801 |
| | PAGARE 13 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 6.281.400 | 6.273 |
| | PAGARE 14 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 267.469 | 267 |
| | PAGARE 15 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 668.116 | 667 |
| | PAGARE 16 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 259.862 | 260 |
| | PAGARE 17 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 80.647 | 81 |
| | PAGARE 18 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 99.026 | 99 |
| | PAGARE 19 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 310.037 | 310 |
| | PAGARE 20 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 121.897 | 122 |
| | PAGARE 21 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 184.410 | 184 |
| | PAGARE 22 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 127.129 | 127 |
| | PAGARE 23 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 519.737 | 517 |
| | PAGARE 24 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 728.677 | 725 |
| | PAGARE 25 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 283.275 | 282 |
| | PAGARE 26 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 628.757 | 625 |

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

| | | | | | | | | | |
|---------------|---|---|---|---|---|---|---|------------|--------|
| PAGARE 27 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 449.127 | 446 |
| PAGARE 28 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 608.611 | 605 |
| PAGARE 29 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.261.950 | 1.260 |
| PAGARE 30 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 657.737 | 657 |
| PAGARE 31 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 214.630 | 214 |
| PAGARE 32 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.947.066 | 1.944 |
| PAGARE 33 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 131.050 | 131 |
| PAGARE 34 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.557.297 | 1.555 |
| PAGARE 35 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 344.143 | 344 |
| PAGARE 36 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.071.187 | 1.070 |
| PAGARE 37 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.612.366 | 1.610 |
| PAGARE 38 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.229.454 | 1.228 |
| PAGARE 39 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 225.679 | 225 |
| PAGARE 40 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 121.449 | 121 |
| PAGARE 41 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 552.514 | 550 |
| PAGARE 42 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 589.565 | 589 |
| PAGARE 43 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 235.139 | 235 |
| PAGARE 44 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 10.985.258 | 10.930 |
| PAGARE 45 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.808.948 | 1.807 |
| PAGARE 46 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 185.776 | 185 |
| PAGARE 47 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 947.835 | 947 |
| PAGARE 48 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 3.632.315 | 3.616 |
| PAGARE 49 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 277.698 | 277 |
| PAGARE 50 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 940.469 | 940 |
| PAGARE 51 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 695.621 | 691 |
| PAGARE 52 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 2.959.854 | 2.947 |
| PAGARE 53 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.237.492 | 1.237 |
| PAGARE 54 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.911.220 | 1.910 |
| PAGARE 55 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.859.398 | 1.851 |
| PAGARE 56 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 778.246 | 778 |
| PAGARE 57 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.089.225 | 1.089 |
| PAGARE 58 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 2.135.749 | 2.134 |
| PAGARE 59 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 2.056.383 | 2.047 |
| PAGARE 60 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 979.713 | 979 |
| PAGARE 61 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 459.538 | 459 |
| PAGARE 62 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 156.559 | 156 |
| PAGARE 63 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 749.447 | 749 |
| PAGARE 64 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 8.239.150 | 8.192 |
| PAGARE 65 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 134.074 | 133 |
| PAGARE 66 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 204.080 | 204 |
| PAGARE 67 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 2.359.342 | 2.358 |

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

| | | | | | | | | | |
|----------------|---|---|---|---|---|---|---|-----------|-------|
| PAGARE 68 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 6.210.603 | 6.178 |
| PAGARE 69 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 3.657.339 | 3.641 |
| PAGARE 70 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 594.142 | 592 |
| PAGARE 71 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 495.500 | 493 |
| PAGARE 72 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 3.073.269 | 3.060 |
| PAGARE 73 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 316.864 | 317 |
| PAGARE 74 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 2.051.878 | 2.051 |
| PAGARE 75 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 599.612 | 599 |
| PAGARE 76 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.145.295 | 1.145 |
| PAGARE 77 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 244.061 | 244 |
| PAGARE 78 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 2.817.166 | 2.816 |
| PAGARE 79 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 656.433 | 656 |
| PAGARE 80 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 152.749 | 153 |
| PAGARE 81 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 837.426 | 834 |
| PAGARE 82 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 361.717 | 360 |
| PAGARE 83 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 240.471 | 239 |
| PAGARE 84 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 2.960.354 | 2.945 |
| PAGARE 85 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 7.998.392 | 7.965 |
| PAGARE 86 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 4.037.556 | 4.021 |
| PAGARE 87 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 849.288 | 846 |
| PAGARE 88 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 2.598.036 | 2.587 |
| PAGARE 89 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 86.096 | 86 |
| PAGARE 90 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 2.396.948 | 2.396 |
| PAGARE 91 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 353.076 | 353 |
| PAGARE 92 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 310.854 | 310 |
| PAGARE 93 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 943.425 | 938 |
| PAGARE 94 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.247.743 | 1.242 |
| PAGARE 95 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.902.616 | 1.895 |
| PAGARE 96 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 128.236 | 128 |
| PAGARE 97 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.212.066 | 1.206 |
| PAGARE 98 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 4.176.438 | 4.176 |
| PAGARE 99 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 350.317 | 350 |
| PAGARE 100 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 573.803 | 571 |
| PAGARE 101 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 7.646.501 | 7.616 |
| PAGARE 102 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 366.812 | 365 |
| PAGARE 103 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 571.290 | 571 |
| PAGARE 104 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 507.096 | 507 |
| PAGARE 105 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 176.558 | 176 |
| PAGARE 106 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 125.681 | 125 |
| PAGARE 107 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 118.980 | 119 |
| PAGARE 108 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 167.291 | 167 |
| PAGARE 109 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 56.432 | 56 |

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

| | | | | | | | | | |
|----------------|---|---|---|---|-----------|-------|---|-----------|-------|
| PAGARE 110 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.884.507 | 1.878 |
| PAGARE 111 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 286.246 | 285 |
| PAGARE 112 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.313.347 | 1.309 |
| PAGARE 113 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 159.532 | 159 |
| PAGARE 114 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 60.715 | 61 |
| PAGARE 115 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.862.595 | 1.856 |
| PAGARE 116 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 128.897 | 128 |
| PAGARE 117 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.390.201 | 1.385 |
| PAGARE 118 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 600.686 | 600 |
| PAGARE 119 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 5.597.355 | 5.580 |
| PAGARE 120 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 885.648 | 883 |
| PAGARE 121 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 624.985 | 623 |
| PAGARE 122 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 537.325 | 536 |
| PAGARE 123 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 172.549 | 172 |
| PAGARE 124 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 133.698 | 133 |
| PAGARE 125 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 140.749 | 141 |
| PAGARE 126 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 178.758 | 178 |
| PAGARE 127 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.109.563 | 1.107 |
| PAGARE 128 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.980.579 | 1.976 |
| PAGARE 129 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.129.439 | 1.126 |
| PAGARE 130 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 124.611 | 124 |
| PAGARE 131 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 199.625 | 199 |
| PAGARE 132 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 917.369 | 913 |
| PAGARE 133 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 6.425.972 | 6.415 |
| PAGARE 134 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 7.537.656 | 7.525 |
| PAGARE 135 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.260.076 | 1.258 |
| PAGARE 136 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 2.405.395 | 2.403 |
| PAGARE 137 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.109.293 | 1.108 |
| PAGARE 138 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.850.908 | 1.849 |
| PAGARE 139 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 921.162 | 920 |
| PAGARE 140 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 972.125 | 971 |
| PAGARE 141 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.447.755 | 1.446 |
| PAGARE 142 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 3.924.660 | 3.923 |
| PAGARE 143 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 3.508.663 | 3.505 |
| PAGARE 144 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 3.670.215 | 3.661 |
| PAGARE 145 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 1 | 769.187 | 767 |
| PAGARE 146 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 2.795.165 | 2.790 | 1 | 2.741.447 | 2.736 |
| PAGARE 147 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 760.720 | 760 | 1 | 746.101 | 745 |
| PAGARE 148 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 1.188.111 | 1.187 | 1 | 1.165.277 | 1.164 |
| PAGARE 149 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 7.027.548 | 7.008 | 1 | 6.892.490 | 6.873 |
| PAGARE 150 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 4.384.215 | 4.367 | 1 | 4.299.957 | 4.283 |
| PAGARE 151 USD | 1 | 0 | 0 | 1 | 583.655 | 583 | 1 | 572.438 | 572 |

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

| | | | | | | | | | | | | | | | |
|--------------|----------------|------|-----|---------|------|-------|------|-----------|-------|------|--------|-----------|-------|------|---------|
| | PAGARE 152 USD | | 1 | 0 | 0 | | 1 | 3.196.381 | 3.192 | | 1 | 3.134.951 | 3.131 | | |
| | PAGARE 153 USD | | 1 | 0 | 0 | | 1 | 1.252.681 | 1.251 | | 1 | 1.228.606 | 1.227 | | |
| | PAGARE 154 USD | | 1 | 0 | 0 | | 1 | 53.512 | 53 | | 1 | 52.484 | 52 | | |
| | PAGARE 155 USD | | 1 | 0 | 0 | | 1 | 491.223 | 491 | | 1 | 481.783 | 481 | | |
| | PAGARE 156 USD | | 1 | 0 | 0 | | 1 | 2.177.409 | 2.175 | | 1 | 2.135.563 | 2.133 | | |
| | PAGARE 157 USD | | 1 | 641.866 | 640 | | 0 | 0 | 0 | | 1 | 641.866 | 640 | | |
| | PAGARE 158 USD | | 1 | 670.175 | 669 | | 0 | 0 | 0 | | 1 | 670.175 | 669 | | |
| | PAGARE 159 USD | | 1 | 829.647 | 828 | | 0 | 0 | 0 | | 1 | 829.647 | 828 | | |
| | PAGARE 160 USD | | 1 | 542.768 | 542 | | 0 | 0 | 0 | | 1 | 542.768 | 542 | | |
| | PAGARE 161 USD | | 1 | 100.168 | 100 | | 0 | 0 | 0 | | 1 | 100.168 | 100 | | |
| Total | | 0723 | 161 | | 0724 | 2.779 | 1723 | 156 | | 1724 | 23.855 | 2723 | 161 | 2724 | 227.135 |

S.05.2

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2023

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 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 2 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 3 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 4 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 5 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,99 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 6 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,99 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 7 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,99 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 8 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,94 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 9 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 10 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,99 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 11 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,99 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 12 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,99 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 13 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 14 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 15 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

| | | | | | | | | | | | |
|---------------|----|------|------|------|---|---|----|---|---|---|---|
| PAGARE 16 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 17 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 18 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 19 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 20 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 21 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 22 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 23 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,99 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 24 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 25 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,99 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 26 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,99 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 27 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,99 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 28 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,99 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 29 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 30 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 31 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 32 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 33 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 34 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 35 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 36 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,45 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 37 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 38 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 39 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 40 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

| | | | | | | | | | | | |
|---------------|----|------|------|------|---|---|----|---|---|---|---|
| PAGARE 41 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 42 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 43 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 44 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,53 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 45 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 46 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 47 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 48 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 49 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 50 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 51 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 52 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 53 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 54 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 55 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 56 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 57 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 58 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 59 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 60 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 61 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 62 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 63 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 64 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 65 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

| | | | | | | | | | | | |
|---------------|----|------|------|------|---|---|----|---|---|---|---|
| PAGARE 66 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 67 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 68 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 69 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 70 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 71 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 72 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 73 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 74 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 75 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 76 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 77 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 78 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 79 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 80 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 81 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 82 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 83 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 84 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 85 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 86 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 87 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 88 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 89 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 90 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

| | | | | | | | | | | | |
|----------------|----|------|------|------|---|---|----|---|---|---|---|
| PAGARE 91 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 92 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 93 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 94 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 95 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 96 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 97 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 98 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 99 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 100 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 101 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 102 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 103 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 104 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 105 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 106 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 107 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 108 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 109 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 110 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 111 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 112 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 113 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 114 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 115 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,66 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

| | | | | | | | | | | | |
|----------------|----|------|------|------|---|---|----|---|---|---|---|
| PAGARE 116 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 117 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,55 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 118 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 119 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 120 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 121 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 122 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 123 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 124 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 125 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,29 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 126 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 127 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 128 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 129 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 130 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 131 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 132 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 133 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 134 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 135 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 136 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,37 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 137 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 138 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 139 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 140 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,42 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 |

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

| | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--------------|----------------|----|------|------|------|------|---|------|-----|------|-------|------|---|------|-------|------|---|
| | PAGARE 141 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 142 USD | NS | FIJO | 0,00 | 0,91 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 143 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 144 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,47 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 145 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,47 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 146 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 147 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 148 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 149 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 150 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,49 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 151 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 152 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 153 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 154 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,50 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 155 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,30 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 156 USD | NS | FIJO | 0,00 | 1,48 | 0 | 0 | NO | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 157 USD | NS | FIJO | 0,00 | 2,00 | 0 | 0 | NO | 640 | 0 | 640 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 158 USD | NS | FIJO | 0,00 | 2,00 | 0 | 0 | NO | 669 | 0 | 669 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 159 USD | NS | FIJO | 0,00 | 2,00 | 0 | 0 | NO | 828 | 0 | 828 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 160 USD | NS | FIJO | 0,00 | 2,00 | 0 | 0 | NO | 542 | 0 | 542 | 0 | | | | | |
| | PAGARE 161 USD | NS | FIJO | 0,00 | 2,00 | 0 | 0 | NO | 100 | 0 | 100 | 0 | | | | | |
| Total | | | | | | 0740 | 0 | 0741 | 0 | 0743 | 2.779 | 0744 | 0 | 0745 | 2.779 | 0746 | 0 |

| | Situación actual 31/03/2023 | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | Situación inicial 19/01/2021 | | | |
|--|-----------------------------|--|------------------------------|------|------|------|
| Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%) | 0747 | 2,00 | 0748 | 1,49 | 0749 | 1,51 |

S.05.2

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

| (miles de euros) | | Situación actual 31/03/2023 | | | | Situación periodo comparativo anterior 31/03/2022 | | | |
|------------------|--------------------|-----------------------------|------------------|-------------------|------------------|---|------------------|-------------------|------------------|
| 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 USD | 0 | 1.486 | 0 | 5 | 0 | 1.486 | 0 | 5 |
| | PAGARE 2 USD | 0 | 1.081 | 0 | 4 | 0 | 1.081 | 0 | 4 |
| | PAGARE 3 USD | 0 | 372 | 0 | 1 | 0 | 372 | 0 | 1 |
| | PAGARE 4 USD | 0 | 422 | 0 | 2 | 0 | 422 | 0 | 2 |
| | PAGARE 5 USD | 0 | 237 | 0 | 0 | 0 | 237 | 0 | 0 |
| | PAGARE 6 USD | 0 | 185 | 0 | 1 | 0 | 185 | 0 | 1 |
| | PAGARE 7 USD | 0 | 930 | 0 | 5 | 0 | 930 | 0 | 5 |
| | PAGARE 8 USD | 0 | 771 | 0 | 3 | 0 | 771 | 0 | 3 |
| | PAGARE 9 USD | 0 | 506 | 0 | 2 | 405 | 405 | 2 | 2 |
| | PAGARE 10 USD | 0 | 925 | 0 | 4 | 762 | 762 | 5 | 5 |
| | PAGARE 11 USD | 0 | 1.097 | 0 | 4 | 904 | 904 | 5 | 5 |
| | PAGARE 12 USD | 0 | 960 | 0 | 4 | 791 | 791 | 5 | 5 |
| | PAGARE 13 USD | 0 | 6.472 | 0 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 14 USD | 0 | 276 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 15 USD | 0 | 688 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 16 USD | 0 | 268 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 17 USD | 0 | 83 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 18 USD | 0 | 102 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 19 USD | 0 | 320 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 20 USD | 0 | 126 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 21 USD | 0 | 190 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 22 USD | 0 | 131 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 23 USD | 0 | 524 | 0 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 24 USD | 0 | 736 | 0 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 25 USD | 0 | 286 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

| | | | | | | | | |
|---------------|---|--------|---|----|---|---|---|---|
| PAGARE 26 USD | 0 | 635 | 0 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 27 USD | 0 | 467 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 28 USD | 0 | 633 | 0 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 29 USD | 0 | 1.300 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 30 USD | 0 | 678 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 31 USD | 0 | 221 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 32 USD | 0 | 2.006 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 33 USD | 0 | 135 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 34 USD | 0 | 1.605 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 35 USD | 0 | 355 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 36 USD | 0 | 1.104 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 37 USD | 0 | 1.661 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 38 USD | 0 | 1.267 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 39 USD | 0 | 240 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 40 USD | 0 | 129 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 41 USD | 0 | 586 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 42 USD | 0 | 608 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 43 USD | 0 | 242 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 44 USD | 0 | 11.656 | 0 | 47 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 45 USD | 0 | 1.865 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 46 USD | 0 | 197 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 47 USD | 0 | 977 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 48 USD | 0 | 3.856 | 0 | 14 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 49 USD | 0 | 286 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 50 USD | 0 | 970 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 51 USD | 0 | 752 | 0 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 52 USD | 0 | 3.142 | 0 | 11 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 53 USD | 0 | 1.276 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 54 USD | 0 | 1.971 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 55 USD | 0 | 1.974 | 0 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 56 USD | 0 | 802 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 57 USD | 0 | 1.123 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 58 USD | 0 | 2.202 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 59 USD | 0 | 2.183 | 0 | 8 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 60 USD | 0 | 1.010 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 61 USD | 0 | 466 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 62 USD | 0 | 161 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 63 USD | 0 | 773 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 64 USD | 0 | 8.908 | 0 | 42 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 65 USD | 0 | 145 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 66 USD | 0 | 210 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 67 USD | 0 | 2.433 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

| | | | | | | | | |
|----------------|---|-------|---|----|---|---|---|---|
| PAGARE 68 USD | 0 | 6.719 | 0 | 28 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 69 USD | 0 | 3.883 | 0 | 14 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 70 USD | 0 | 631 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 71 USD | 0 | 526 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 72 USD | 0 | 3.263 | 0 | 12 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 73 USD | 0 | 327 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 74 USD | 0 | 2.116 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 75 USD | 0 | 618 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 76 USD | 0 | 1.181 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 77 USD | 0 | 252 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 78 USD | 0 | 2.906 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 79 USD | 0 | 677 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 80 USD | 0 | 155 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 81 USD | 0 | 889 | 0 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 82 USD | 0 | 384 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 83 USD | 0 | 255 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 84 USD | 0 | 3.203 | 0 | 13 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 85 USD | 0 | 8.494 | 0 | 29 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 86 USD | 0 | 4.288 | 0 | 15 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 87 USD | 0 | 902 | 0 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 88 USD | 0 | 2.759 | 0 | 10 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 89 USD | 0 | 89 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 90 USD | 0 | 2.472 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 91 USD | 0 | 358 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 92 USD | 0 | 330 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 93 USD | 0 | 1.020 | 0 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 94 USD | 0 | 1.325 | 0 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 95 USD | 0 | 2.021 | 0 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 96 USD | 0 | 136 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 97 USD | 0 | 1.311 | 0 | 6 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 98 USD | 0 | 4.309 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 99 USD | 0 | 361 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 100 USD | 0 | 621 | 0 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 101 USD | 0 | 8.122 | 0 | 26 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 102 USD | 0 | 390 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 103 USD | 0 | 589 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 104 USD | 0 | 514 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 105 USD | 0 | 191 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 106 USD | 0 | 134 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 107 USD | 0 | 126 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 108 USD | 0 | 178 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 109 USD | 0 | 57 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

| | | | | | | | | |
|----------------|-------|-------|----|----|---|---|---|---|
| PAGARE 110 USD | 0 | 2.002 | 0 | 6 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 111 USD | 0 | 310 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 112 USD | 0 | 1.396 | 0 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 113 USD | 0 | 173 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 114 USD | 0 | 65 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 115 USD | 0 | 1.979 | 0 | 6 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 116 USD | 0 | 140 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 117 USD | 0 | 1.477 | 0 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 118 USD | 0 | 609 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 119 USD | 0 | 5.950 | 0 | 15 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 120 USD | 0 | 942 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 121 USD | 0 | 664 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 122 USD | 0 | 571 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 123 USD | 0 | 183 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 124 USD | 0 | 145 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 125 USD | 0 | 143 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 126 USD | 0 | 194 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 127 USD | 0 | 1.180 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 128 USD | 0 | 2.107 | 0 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 129 USD | 0 | 1.224 | 0 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 130 USD | 0 | 133 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 131 USD | 0 | 212 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 132 USD | 0 | 1.002 | 0 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 133 USD | 0 | 6.841 | 0 | 9 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 134 USD | 0 | 8.025 | 0 | 11 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 135 USD | 0 | 1.368 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 136 USD | 0 | 2.563 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 137 USD | 0 | 1.181 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 138 USD | 0 | 1.971 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 139 USD | 0 | 981 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 140 USD | 0 | 1.065 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 141 USD | 0 | 1.586 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 142 USD | 0 | 4.303 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 143 USD | 0 | 3.845 | 0 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 144 USD | 0 | 3.838 | 0 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 145 USD | 0 | 804 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 146 USD | 2.747 | 2.747 | 4 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 147 USD | 748 | 748 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 148 USD | 1.168 | 1.168 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 149 USD | 7.039 | 7.039 | 16 | 16 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 150 USD | 4.283 | 4.283 | 14 | 14 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PAGARE 151 USD | 574 | 574 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

| | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--------------|----------------|-------|---------|------|---------|------|----|------|-----|------|-------|------|-------|------|----|------|----|
| | PAGARE 152 USD | 3.143 | 3.143 | 3 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 153 USD | 1.232 | 1.232 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 154 USD | 53 | 53 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 155 USD | 483 | 483 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 156 USD | 2.184 | 2.141 | 2 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 157 USD | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 158 USD | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 159 USD | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 160 USD | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | PAGARE 161 USD | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total | | 0754 | 236.654 | 0755 | 236.248 | 0756 | 44 | 0757 | 560 | 1754 | 2.861 | 1755 | 8.346 | 1756 | 17 | 1757 | 37 |

| |
|---|
| S.05.2 |
| Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT |
| Denominación del compartimento: 202100002 |
| Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT |
| Estados agregados: NO |
| Periodo de la declaración: 31/03/2023 |
| 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 31/03/2023 | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | Situación inicial 19/01/2021 |
| | | 0760 | 0761 | 0762 | 0763 | 0764 |

S.05.2

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2023

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 31/03/2023 | | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | | Situación inicial 19/01/2021 | |
| Inferior a 1 año | 0765 | 2.779 | 1765 | 23.855 | 2765 | 227.135 |
| 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 | 2.779 | 1772 | 23.855 | 2772 | 227.135 |
| Vida residual media ponderada (años) | 0773 | 0,10 | 1773 | 0,11 | 2773 | 0,19 |

S.05.3

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

| Información sobre las mejoras crediticias del Fondo | | Situación actual 31/03/2023 | | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | | 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 | 100,00 | 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: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

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 31/03/2023 | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | 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: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

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 31/03/2023 | | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | | Situación inicial 19/01/2021 | | Situación actual 31/03/2023 | | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | | 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 titulación | 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: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

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 31/03/2023 | | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | | Situación actual 31/03/2023 | | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | | | | 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 31/03/2023 | | Situación cierre anual anterior 31/12/2022 | | | 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: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

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: 202100002 |
| Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT |
| Estados agregados: NO |
| Fecha: 31/03/2023 |

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: 202100002 |
| Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT |
| Estados agregados: NO |
| Fecha: 31/03/2023 |

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 |
|--|------|---------------|------------|------------|--|-------|
| | | 31/01/2023 | 28/02/2023 | 31/03/2023 | | |
| Ingresos y gastos del periodo de cálculo | 0872 | | | | | |
| Margen de intereses | 0873 | 9 | 27 | 4 | | 40 |
| 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 | -19 | -16 | -5 | | -40 |
| Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A) | 0878 | -9 | 11 | -1 | | 0 |
| Impuesto sobre beneficios (-) (B) | 0879 | | | | | |
| Repercusión de ganancias (-) (C) | 0880 | | | | | |
| Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D) | 0881 | | | | | |
| Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)] | 0882 | 9 | -11 | 1 | | 0 |
| Comisión variable pagada | 0883 | | | | | |
| Comisión variable impagada en el periodo de cálculo | 0884 | | | | | |

S.05.5

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

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

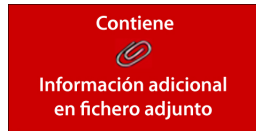
Denominación del compartimento: 202100002

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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