

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:
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION, S.A., SGFT
NIF Gestora: A88248166
Fondo Abierto: SI
Fondo Privado: SI
Estados agregados: SI
Fecha: 31/03/2022

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:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2022		Periodo anterior 31/12/2021
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		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025		1025	
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027		1027	
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

S.01

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2022		Periodo anterior 31/12/2021
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	97.767	1041	3.017
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	97.742	1043	2.967
1. Activos titulizados	0044	97.646	1044	2.967
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046		1046	
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	
1.16 Cuentas a cobrar	0060	97.646	1060	2.788
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	0
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	0
1.20 Otros	0064		1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065		1065	179
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066		1066	
1.23 Activos dudosos -principal-	0067		1067	
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068		1068	
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069		1069	
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	97	1074	
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	97	1077	
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignoralos o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	7
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	7
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	25	1085	43
1. Tesorería	0086	25	1086	43
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	97.767	1088	3.017

S.01

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2022		Periodo anterior 31/12/2021
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	97.646	1089	2.788
I. Provisiones a largo plazo	0090		1090	
1. Provisión garantías financieras	0091		1091	
2. Provisión por margen de intermediación	0092		1092	
3. Otras provisiones	0093		1093	
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	97.646	1094	2.788
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	97.646	1095	2.788
1.1 Series no subordinadas	0096	97.646	1096	2.788
1.2 Series subordinadas	0097	0	1097	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101		1101	
2.1 Préstamo subordinado	0102		1102	
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105		1105	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108		1108	
3.1 Derivados de cobertura	0109		1109	
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

S.01
Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT
Estados agregados: SI
Fecha: 31/03/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2022		Periodo anterior 31/12/2021
B) PASIVO CORRIENTE	0117	122	1117	229
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	
V. Provisiones a corto plazo	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120		1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121		1121	
3. Otras provisiones	0122		1122	
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	56	1123	14
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	47	1124	5
1.1 Series no subordinadas	0125		1125	
1.2 Series subordinadas	0126		1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	47	1128	5
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	9	1131	9
2.1 Préstamo subordinado	0132	9	1132	9
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136		1136	
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139		1139	
3.1 Derivados de cobertura	0140		1140	
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143		1143	
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144		1144	
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	66	1148	215
1. Comisiones	0149	57	1149	193
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	11	1150	6
1.2 Comisión administrador	0151	18	1151	11
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	28	1153	176
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	0
2. Otros	0157	9	1157	22
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158		1158	
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160		1160	
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	97.767	1162	3.017

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2022		Acumulado anterior 31/03/2021
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	112	1201		2201	112	3201	
1.1 Activos titulizados	0202	112	1202		2202	112	3202	
1.2 Otros activos financieros	0203		1203		2203		3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-58	1204		2204	-58	3204	
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-58	1205		2205	-58	3205	
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	0	1206		2206		3206	
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207		2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208		1208		2208		3208	
A) MARGEN DE INTERESES	0209	54	1209		2209	54	3209	
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210		1210		2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211		1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212		1212		2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213		1213		2213		3213	
4.4 Otros	0214		1214		2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	-1	1215		2215	-1	3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216		1216		2216		3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-60	1217		2217	-60	3217	
7.1 Servicios exteriores	0218	-4	1218		2218	-4	3218	
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-3	1219		2219	-3	3219	
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	-1	1220		2220	-1	3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221		2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222		3222	
7.2 Tributos	0223	0	1223		2223		3223	
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-55	1224		2224	-55	3224	
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-12	1225		2225	-12	3225	
7.3.2 Comisión administrador	0226	-20	1226		2226	-20	3226	
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227		2227		3227	
7.3.4 Comisión variable	0228	-23	1228		2228	-23	3228	
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229		2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230		2230		3230	
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231		1231		2231		3231	
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232		1232		2232		3232	
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233		1233		2233		3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234		1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235		1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236		1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237		1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238		1238		2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	6	1239		2239	6	3239	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240		1240		2240		3240	
12. Impuesto sobre beneficios	0241		1241		2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2022		Acumulado anterior 31/03/2021
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-9	1300		2300	-9	3300	
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	13	1301		2301	13	3301	
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	30	1302		2302	30	3302	
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-17	1303		2303	-17	3303	
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304		1304		2304		3304	
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305		1305		2305		3305	
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306		1306		2306		3306	
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307		1307		2307		3307	
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308		2308		3308	
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-22	1309		2309	-22	3309	
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-7	1310		2310	-7	3310	
2.2 Comisión administrador	0311	-13	1311		2311	-13	3311	
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-1	1312		2312	-1	3312	
2.4 Comisión variable	0313	0	1313		2313		3313	
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314		2314		3314	
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315		1315		2315		3315	
3.1 Pagos por garantías financieras	0316		1316		2316		3316	
3.2 Cobros por garantías financieras	0317		1317		2317		3317	
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318		1318		2318		3318	
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319		1319		2319		3319	
3.5 Otros pagos de explotación	0320		1320		2320		3320	
3.6 Otros cobros de explotación	0321		1321		2321		3321	
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-9	1322		2322	-9	3322	
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	97.557	1323		2323	97.557	3323	
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	-97.557	1324		2324	-97.557	3324	
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-12	1325		2325	-12	3325	
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	2.850	1326		2326	2.850	3326	
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327		1327		2327		3327	
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328		1328		2328		3328	
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329		1329		2329		3329	
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330		1330		2330		3330	
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-2.861	1331		2331	-2.861	3331	
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	3	1332		2332	3	3332	
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333		2333		3333	
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334		2334		3334	
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	-12	1335		2335	-12	3335	
7.4 Otros cobros y pagos	0336	14	1336		2336	14	3336	
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-18	1337		2337	-18	3337	
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	43	1338		2338	43	3338	0
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	25	1339		2339	25	3339	

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2022		Acumulado anterior 31/03/2021
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:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/03/2022								Situación cierre anual anterior 31/12/2021								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:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

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	0	0481	0	0488		0495	0	0502	0	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:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

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 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 19/01/2021	
Inferior a 1 año	0600	97.646	1600	2.788	2600	117.276
Entre 1 y 2 años	0601	0	1601	0	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	0	1602	0	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	0	1603	0	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	0	1604	0	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	0	1605	0	2605	0
Superior a 10 años	0606	0	1606	0	2606	0
Total	0607	97.646	1607	2.788	2607	117.276
Vida residual media ponderada (años)	0608	0,19	1608	0,20	2608	0,24

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 19/01/2021	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	0,09	1609	0,30	2609	0,07

S.05.1

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

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 31/03/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

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 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 19/01/2021	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,01	1650	3,43	2650	3,05
Tipo de interés nominal máximo	0651	3,50	1651	3,50	2651	3,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	3,00	1652	3,00	2652	3,00

S.05.1

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

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 31/03/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	399	0695	97.646	1672	11	1695	2.788	2672	470	2695	117.276
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	399	0702	97.646	1679	11	1702	2.788	2679	470	2702	117.276
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680		2703	
Resto	0681		0704		1681		1704		2681		2704	
Total general	0682	399	0705	97.646	1682	11	1705	2.788	2682	470	2705	117.276

S.05.1
Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT
Estados agregados: SI
Fecha: 31/03/2022
Entidades cedentes de los activos titulizados: ZEPA FINANCE, S.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/03/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	100,00		
Sector	0711	88,47	0712	7.112	1711	68,41	1712	7.112	2711	86,77	2712	7.112

S.05.2

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2022			Situación cierre anual anterior 31/12/2021			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 49 USD	1	274.139	274	0	0	0	1	274.139	274
	PAGARE 50 USD	1	928.416	928	0	0	0	1	928.416	928
	PAGARE 71 USD	1	489.150	487	0	0	0	1	489.150	487
	PAGARE 72 USD	1	3.033.882	3.020	0	0	0	1	3.033.882	3.020
	PAGARE 51 USD	1	686.706	683	0	0	0	1	686.706	683
	PAGARE 52 USD	1	2.921.921	2.909	0	0	0	1	2.921.921	2.909
	PAGARE 53 USD	1	1.221.633	1.221	0	0	0	1	1.221.633	1.221
	PAGARE 54 USD	1	1.886.726	1.885	0	0	0	1	1.886.726	1.885
	PAGARE 55 USD	1	1.835.568	1.827	0	0	0	1	1.835.568	1.827
	PAGARE 56 USD	1	768.272	768	0	0	0	1	768.272	768
	PAGARE 57 USD	1	1.075.265	1.075	0	0	0	1	1.075.265	1.075
	PAGARE 58 USD	1	2.108.377	2.107	0	0	0	1	2.108.377	2.107
	PAGARE 9 EUR	1	0	0	0	0	0	1	2.882.457	2.865
	PAGARE 59 USD	1	2.030.028	2.021	0	0	0	1	2.030.028	2.021
	PAGARE 10 EUR	1	0	0	0	0	0	1	671.134	668
	PAGARE 60 USD	1	967.157	966	0	0	0	1	967.157	966
	PAGARE 11 EUR	1	299.762	300	0	0	0	1	299.762	300
	PAGARE 12 EUR	1	164.206	164	0	0	0	1	164.206	164
	PAGARE 13 EUR	1	193.284	193	0	0	0	1	193.284	193
	PAGARE 14 EUR	1	811.550	811	0	0	0	1	811.550	811
	PAGARE 15 EUR	1	44.086	44	0	0	0	1	44.086	44
	PAGARE 16 EUR	1	432.952	432	0	0	0	1	432.952	432
	PAGARE 17 EUR	1	439.011	439	0	0	0	1	439.011	439
	PAGARE 18 EUR	1	147.006	147	0	0	0	1	147.006	147
	PAGARE 1 EUR	1	0	0	0	0	0	1	925.722	923
	PAGARE 2 EUR	1	0	0	0	0	0	1	633.164	630

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

PAGARE 3 EUR	1	0	0	0	0	0	1	132.304	132
PAGARE 4 EUR	1	0	0	0	0	0	1	59.583	59
PAGARE 5 EUR	1	0	0	0	0	0	1	567.768	565
PAGARE 6 EUR	1	0	0	0	0	0	1	402.139	400
PAGARE 7 EUR	1	0	0	0	0	0	1	230.375	229
PAGARE 8 EUR	1	0	0	0	0	0	1	4.474.043	4.448
PAGARE 19 EUR	1	910.818	910	0	0	0	1	910.818	910
PAGARE 20 EUR	1	264.523	264	0	0	0	1	264.523	264
PAGARE 21 EUR	1	280.589	280	0	0	0	1	280.589	280
PAGARE 22 EUR	1	247.176	247	0	0	0	1	247.176	247
PAGARE 23 EUR	1	2.236.612	2.235	0	0	0	1	2.236.612	2.235
PAGARE 24 EUR	1	33.598	34	0	0	0	1	33.598	34
PAGARE 25 EUR	1	37.741	38	0	0	0	1	37.741	38
PAGARE 26 EUR	1	215.564	215	0	0	0	1	215.564	215
PAGARE 27 EUR	1	113.953	113	0	0	0	1	113.953	113
PAGARE 28 EUR	1	245.274	244	0	0	0	1	245.274	244
PAGARE 29 EUR	1	1.830.085	1.821	0	0	0	1	1.830.085	1.821
PAGARE 30 EUR	1	264.571	263	0	0	0	1	264.571	263
PAGARE 31 EUR	1	591.753	589	0	0	0	1	591.753	589
PAGARE 32 EUR	1	119.245	119	0	0	0	1	119.245	119
PAGARE 33 EUR	1	187.979	187	0	0	0	1	187.979	187
PAGARE 34 EUR	1	90.617	90	0	0	0	1	90.617	90
PAGARE 35 EUR	1	728.163	725	0	0	0	1	728.163	725
PAGARE 36 EUR	1	1.559.437	1.553	0	0	0	1	1.559.437	1.553
PAGARE 37 EUR	1	407.535	407	0	0	0	1	407.535	407
PAGARE 38 EUR	1	1.962.583	1.954	0	0	0	1	1.962.583	1.954
PAGARE 1 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.602.080	1.595
PAGARE 2 USD	1	0	0	1	0	0	1	1.164.753	1.160
PAGARE 3 USD	1	0	0	1	0	0	1	400.552	399
PAGARE 4 USD	1	0	0	1	0	0	1	455.449	453
PAGARE 5 USD	1	0	0	1	0	0	1	199.162	198
PAGARE 6 USD	1	0	0	1	0	0	1	253.759	253
PAGARE 7 USD	1	0	0	1	0	0	1	985.134	979
PAGARE 8 USD	1	0	0	1	0	0	1	815.447	812
PAGARE 9 USD	1	0	0	1	396.103	394	1	406.553	405
PAGARE 10 USD	1	0	0	1	746.791	742	1	766.492	762
PAGARE 11 USD	1	0	0	1	885.816	881	1	909.185	904
PAGARE 12 USD	1	0	0	1	775.484	771	1	795.942	791
PAGARE 13 USD	1	6.200.898	6.193	0	0	0	1	6.200.898	6.193
PAGARE 14 USD	1	264.041	264	0	0	0	1	264.041	264
PAGARE 15 USD	1	659.554	659	0	0	0	1	659.554	659
PAGARE 16 USD	1	256.532	256	0	0	0	1	256.532	256

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

PAGARE 17 USD	1	79.614	80	0	0	0	1	79.614	80
PAGARE 18 USD	1	97.757	98	0	0	0	1	97.757	98
PAGARE 19 USD	1	306.064	306	0	0	0	1	306.064	306
PAGARE 20 USD	1	120.335	120	0	0	0	1	120.335	120
PAGARE 21 USD	1	182.046	182	0	0	0	1	182.046	182
PAGARE 22 USD	1	125.499	125	0	0	0	1	125.499	125
PAGARE 23 USD	1	513.076	510	0	0	0	1	513.076	510
PAGARE 24 USD	1	719.339	716	0	0	0	1	719.339	716
PAGARE 25 USD	1	279.645	278	0	0	0	1	279.645	278
PAGARE 26 USD	1	620.699	617	0	0	0	1	620.699	617
PAGARE 27 USD	1	443.371	441	0	0	0	1	443.371	441
PAGARE 28 USD	1	600.811	597	0	0	0	1	600.811	597
PAGARE 29 USD	1	1.245.777	1.244	0	0	0	1	1.245.777	1.244
PAGARE 30 USD	1	649.308	648	0	0	0	1	649.308	648
PAGARE 31 USD	1	211.879	212	0	0	0	1	211.879	212
PAGARE 32 USD	1	1.922.113	1.920	0	0	0	1	1.922.113	1.920
PAGARE 33 USD	1	129.370	129	0	0	0	1	129.370	129
PAGARE 34 USD	1	1.537.339	1.535	0	0	0	1	1.537.339	1.535
PAGARE 35 USD	1	339.733	339	0	0	0	1	339.733	339
PAGARE 36 USD	1	1.057.459	1.056	0	0	0	1	1.057.459	1.056
PAGARE 37 USD	1	1.591.702	1.590	0	0	0	1	1.591.702	1.590
PAGARE 38 USD	1	1.213.698	1.212	0	0	0	1	1.213.698	1.212
PAGARE 39 USD	1	222.787	222	0	0	0	1	222.787	222
PAGARE 40 USD	1	119.893	119	0	0	0	1	119.893	119
PAGARE 61 USD	1	453.649	453	0	0	0	1	453.649	453
PAGARE 62 USD	1	154.553	154	0	0	0	1	154.553	154
PAGARE 63 USD	1	739.842	739	0	0	0	1	739.842	739
PAGARE 64 USD	1	8.133.558	8.087	0	0	0	1	8.133.558	8.087
PAGARE 65 USD	1	132.356	132	0	0	0	1	132.356	132
PAGARE 66 USD	1	201.465	201	0	0	0	1	201.465	201
PAGARE 67 USD	1	2.329.105	2.328	0	0	0	1	2.329.105	2.328
PAGARE 41 USD	1	545.433	543	0	0	0	1	545.433	543
PAGARE 68 USD	1	6.131.008	6.099	0	0	0	1	6.131.008	6.099
PAGARE 42 USD	1	582.009	582	0	0	0	1	582.009	582
PAGARE 69 USD	1	3.610.466	3.595	0	0	0	1	3.610.466	3.595
PAGARE 43 USD	1	232.126	232	0	0	0	1	232.126	232
PAGARE 70 USD	1	586.528	584	0	0	0	1	586.528	584
PAGARE 44 USD	1	10.844.472	10.790	0	0	0	1	10.844.472	10.790
PAGARE 45 USD	1	1.785.764	1.784	0	0	0	1	1.785.764	1.784
PAGARE 46 USD	1	183.395	183	0	0	0	1	183.395	183
PAGARE 47 USD	1	935.688	935	0	0	0	1	935.688	935

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

	PAGARE 48 USD		1	3.585.764		3.569		0		0		0		1	3.585.764		3.569
Total		0723	110		0724	97.646	1723	12		1724	2.788	2723	110		2724	117.276	

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2022

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	0738	0739
									0730	0731		
	PAGARE 49 USD	NS	FIJO	0,00	1,99	2	0	NO	510	0	512	0
	PAGARE 50 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	2	0	NO	716	0	718	0
	PAGARE 71 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	487	0	487	0
	PAGARE 72 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	3.020	0	3.021	0
	PAGARE 51 USD	NS	FIJO	0,00	1,99	1	0	NO	278	0	279	0
	PAGARE 52 USD	NS	FIJO	0,00	1,99	2	0	NO	617	0	619	0
	PAGARE 53 USD	NS	FIJO	0,00	1,99	1	0	NO	441	0	442	0
	PAGARE 54 USD	NS	FIJO	0,00	1,99	1	0	NO	597	0	598	0
	PAGARE 55 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	222	0	222	0
	PAGARE 56 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	119	0	119	0
	PAGARE 57 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	543	0	543	0
	PAGARE 58 USD	NS	FIJO	0,00	1,53	6	0	NO	10.790	0	10.796	0
	PAGARE 9 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
	PAGARE 59 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	183	0	183	0
	PAGARE 10 EUR	NS	FIJO	0,00	1,47	0	0	NO	0	0	0	0

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

PAGARE 60 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	1	0	NO	3.569	0	3.571	0
PAGARE 11 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	300	0	300	0
PAGARE 12 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	164	0	164	0
PAGARE 13 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	193	0	193	0
PAGARE 14 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	1	0	NO	811	0	811	0
PAGARE 15 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	44	0	44	0
PAGARE 16 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	432	0	433	0
PAGARE 17 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	439	0	439	0
PAGARE 18 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	147	0	147	0
PAGARE 1 EUR	NS	FIJO	0,00	1,01	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 2 EUR	NS	FIJO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 3 EUR	NS	FIJO	0,00	1,95	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 4 EUR	NS	FIJO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 5 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 6 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 7 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 8 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 19 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	910	0	910	0
PAGARE 20 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	264	0	264	0
PAGARE 21 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	280	0	280	0
PAGARE 22 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	247	0	247	0
PAGARE 23 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	1	0	NO	2.235	0	2.235	0
PAGARE 24 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	34	0	34	0
PAGARE 25 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	38	0	38	0
PAGARE 26 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	215	0	215	0

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

PAGARE 27 EUR	NS	FIJO	0,00	1,99	0	0	NO	113	0	114	0
PAGARE 28 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	244	0	244	0
PAGARE 29 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	1	0	NO	1.821	0	1.822	0
PAGARE 30 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	263	0	263	0
PAGARE 31 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	589	0	589	0
PAGARE 32 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	119	0	119	0
PAGARE 33 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	187	0	187	0
PAGARE 34 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	90	0	90	0
PAGARE 35 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	725	0	725	0
PAGARE 36 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	1.553	0	1.553	0
PAGARE 37 EUR	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	407	0	407	0
PAGARE 38 EUR	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	1.954	0	1.954	0
PAGARE 1 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 2 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 3 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 4 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 5 USD	NS	FIJO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 6 USD	NS	FIJO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 7 USD	NS	FIJO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 8 USD	NS	FIJO	0,00	1,95	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 9 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 10 USD	NS	FIJO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 11 USD	NS	FIJO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 12 USD	NS	FIJO	0,00	2,00	0	0	NO	0	0	0	0
PAGARE 13 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	7	0	NO	6.193	0	6.199	0

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

PAGARE 14 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	264	0	264	0
PAGARE 15 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	1	0	NO	659	0	659	0
PAGARE 16 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	256	0	256	0
PAGARE 17 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	80	0	80	0
PAGARE 18 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	98	0	98	0
PAGARE 19 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	306	0	306	0
PAGARE 20 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	120	0	120	0
PAGARE 21 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	182	0	182	0
PAGARE 22 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	125	0	125	0
PAGARE 23 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	1	0	NO	1.244	0	1.245	0
PAGARE 24 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	1	0	NO	648	0	649	0
PAGARE 25 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	212	0	212	0
PAGARE 26 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	2	0	NO	1.920	0	1.921	0
PAGARE 27 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	129	0	129	0
PAGARE 28 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	1	0	NO	1.535	0	1.537	0
PAGARE 29 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	339	0	340	0
PAGARE 30 USD	NS	FIJO	0,00	1,45	1	0	NO	1.056	0	1.057	0
PAGARE 31 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	1	0	NO	1.590	0	1.591	0
PAGARE 32 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	1	0	NO	1.212	0	1.213	0
PAGARE 33 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	582	0	582	0
PAGARE 34 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	232	0	232	0
PAGARE 35 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	1	0	NO	1.784	0	1.785	0
PAGARE 36 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	935	0	935	0
PAGARE 37 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	274	0	274	0
PAGARE 38 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	928	0	928	0

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

	PAGARE 39 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	1.221	0	1.221	0					
	PAGARE 40 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	1.885	0	1.886	0					
	PAGARE 61 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	683	0	683	0					
	PAGARE 62 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	1	0	NO	2.909	0	2.910	0					
	PAGARE 63 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	1.827	0	1.828	0					
	PAGARE 64 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	2.021	0	2.021	0					
	PAGARE 65 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	453	0	453	0					
	PAGARE 66 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	1	0	NO	8.087	0	8.087	0					
	PAGARE 67 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	132	0	132	0					
	PAGARE 41 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	768	0	768	0					
	PAGARE 68 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	1	0	NO	6.099	0	6.100	0					
	PAGARE 42 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	1.075	0	1.075	0					
	PAGARE 69 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	3.595	0	3.595	0					
	PAGARE 43 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	1	0	NO	2.107	0	2.107	0					
	PAGARE 70 USD	NS	FIJO	0,00	1,49	0	0	NO	584	0	584	0					
	PAGARE 44 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	966	0	967	0					
	PAGARE 45 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	154	0	154	0					
	PAGARE 46 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	739	0	740	0					
	PAGARE 47 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	201	0	201	0					
	PAGARE 48 USD	NS	FIJO	0,00	1,50	0	0	NO	2.328	0	2.328	0					
Total						0740	47	0741	0	0743	97.646	0744	0	0745	97.693	0746	0

	Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 19/01/2021	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	1,51	0748	1,98	0749	1,53

S.05.2

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2022				Situación periodo comparativo anterior 31/03/2021			
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 49 USD	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 50 USD	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 71 USD	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 72 USD	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 51 USD	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 52 USD	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 53 USD	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 54 USD	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 55 USD	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 56 USD	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 57 USD	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 58 USD	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 9 EUR	0	2.865	0	14	0	0	0	0
	PAGARE 59 USD	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 10 EUR	0	668	0	2	0	0	0	0
	PAGARE 60 USD	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 11 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 12 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 13 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 14 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 15 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 16 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 17 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 18 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
	PAGARE 1 EUR	0	923	0	2	0	0	0	0

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

PAGARE 2 EUR	0	630	0	3	0	0	0	0
PAGARE 3 EUR	0	132	0	1	0	0	0	0
PAGARE 4 EUR	0	59	0	0	0	0	0	0
PAGARE 5 EUR	0	565	0	2	0	0	0	0
PAGARE 6 EUR	0	400	0	1	0	0	0	0
PAGARE 7 EUR	0	229	0	1	0	0	0	0
PAGARE 8 EUR	0	4.448	0	21	0	0	0	0
PAGARE 19 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 20 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 21 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 22 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 23 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 24 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 25 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 26 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 27 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 28 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 29 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 30 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 31 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 32 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 33 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 34 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 35 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 36 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 37 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 38 EUR	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 1 USD	0	1.486	0	5	0	0	0	0
PAGARE 2 USD	0	1.081	0	4	0	0	0	0
PAGARE 3 USD	0	372	0	1	0	0	0	0
PAGARE 4 USD	0	422	0	2	0	0	0	0
PAGARE 5 USD	0	237	0	0	0	0	0	0
PAGARE 6 USD	0	185	0	1	0	0	0	0
PAGARE 7 USD	0	930	0	5	0	0	0	0
PAGARE 8 USD	0	771	0	3	0	0	0	0
PAGARE 9 USD	405	405	2	2	0	0	0	0
PAGARE 10 USD	762	762	5	5	0	0	0	0
PAGARE 11 USD	904	904	5	5	0	0	0	0
PAGARE 12 USD	791	791	5	5	0	0	0	0
PAGARE 13 USD	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 14 USD	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 15 USD	0	0	0	0	0	0	0	0

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

PAGARE 16 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 17 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 18 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 19 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 20 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 21 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 22 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 23 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 24 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 25 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 26 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 27 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 28 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 29 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 30 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 31 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 32 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 33 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 34 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 35 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 36 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 37 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 38 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 39 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 40 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 61 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 62 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 63 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 64 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 65 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 66 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 67 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 41 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 68 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 42 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 69 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 43 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 70 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 44 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 45 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 46 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PAGARE 47 USD	0	0	0	0	0	0	0	0	0

EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

	PAGARE 48 USD		0		0		0		0		0		0		0		0
Total		0754	2.861	0755	19.266	0756	17	0757	85	1754	0	1755	0	1756	0	1757	0

S.05.2
Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT
Estados agregados: SI
Periodo de la declaración: 31/03/2022
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 31/03/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Situación inicial 19/01/2021
		0760	0761	0762	0763	0764

S.05.2

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2022

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 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 19/01/2021	
Inferior a 1 año	0765	97.646	1765	2.788	2765	117.276
Entre 1 y 2 años	0766	0	1766		2766	0
Entre 2 y 3 años	0767	0	1767		2767	0
Entre 3 y 4 años	0768	0	1768		2768	0
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769		2769	0
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770		2770	0
Superior a 10 años	0771	0	1771		2771	0
Total	0772	97.646	1772	2.788	2772	117.276
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,21	1773	0,20	2773	0,23

S.05.3

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		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:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

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 31/03/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	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:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

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 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 19/01/2021		Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		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:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

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 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021			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:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

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:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

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	

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

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	
		31/01/2022	28/02/2022	31/03/2022										
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872													
Margen de intereses	0873	4	10	53	0	0	0	0	0	0	0	0	0	67
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	-6	-13	-37	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-56
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	-2	-3	17										11
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879													
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880													
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881	-1	-3	-23										-27
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	3	6	6										15
Comisión variable pagada	0883													
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884	0												

S.05.5

Denominación Fondo: EBN ALPHA SECTOR PRIVADO,, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

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:

Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION SAU, SGFT

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2022

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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