

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

Actual / Current	14.08.2023
Actual / Current	31.07.2023
Precedente / Preceding	16.05.2023
Precedente / Preceding	14.06.2021

1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation
1.1 Datos: Préstamos Hipotecarios / Data: Mortgage Loans

			Fecha datos Data date	Valor / Importe Value / Amount	Cálculo Ratio Ratio calculation	Ratio (valor) Ratio (value)
a	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans	(b + c + d)		2.014.888.836,32		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <12 meses) (>3 and <12 months)	31.07.2023	811.510,18	% (b / e)	0,040%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses) (≤ 3 months)	31.07.2023	2.012.942.212,82		
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥ 12 meses) (≥ 12 months)	31.07.2023	1.135.113,32		
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<12 meses) (<12 months)	31.07.2023	2.013.753.723,00	% (e / g)	80,55%
g	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		14.06.2021	2.499.864.300,94		

1.2 Datos: / Data:

A	Saldo Principal Pendiente Bonos A Outstanding Principal Balance Bons A		Precedente Preceding	16.05.2023	1.917.802.335,00	
B	Saldo Principal Pendiente Bonos B Outstanding Principal Balance Bons B		Precedente Preceding	16.05.2023	150.000.000,00	
h	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Precedente Preceding	16.05.2023	125.000.000,00	
i	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve		Precedente Preceding	16.05.2023	125.000.000,00	(i - h) 0,00
j	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Actual Current	14.08.2023	125.000.000,00	
k	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve		Actual Current	14.08.2023	125.000.000,00	(k - j) 0,00

2 Situación disparadores / Triggers status
2.1 Postegación Fondo Reserva

	Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Actúa S/N Breach Y/N
2.1	14.08.2023	A=0	Bonos A amortizados	1.917.802.335,00	N
2.2					N
2.2.1					N
2.2.2	14.08.2023	% $i((A+B)-(A+B)-e)$	> 10,00%	6,2%	N
(i)	31.07.2023	% (b / e)	> 1,00%	0,040%	N
(ii)	14.08.2023	(k - j)	< 0,00	0,00	N
(iii)	14.08.2023	14.06.2021	años/years < 3,00	2,17	SY

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

3 Amortización Anticipada opcional / Optional Early Amortization

	Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Opción ejercitable S/N Exercisable option Y/N
3	31.07.2023	% (a / g)	< 10,00%	80,60%	N