

Fecha de Pago / Payment Date	Actual / Current	17.10.2023
Fecha de Determinación / Determination Date	Actual / Current	10.10.2023
Fecha de Pago / Payment Date	Precedente / Preceding	17.07.2023
Fecha constitución Fondo / Fund establishment date		20.11.2006

**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)		Actual Current		245.281.834,25 %	(a / f) 15,83%
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <18 meses)	10.10.2023	667.043,42			% (b / e) 0,278%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Do)	(≤ 3 meses)	10.10.2023	239.643.375,27			
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥ 18 meses)	10.10.2023	4.971.415,56			
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<18 meses)	10.10.2023	240.310.418,69			% (e / f) 15,51%
f	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		20.11.2006	1.549.431.516,52			
g	Margen medio ponderado de Préstamos Hipotecarios Weighted average margin of Mortgage Loans		10.10.2023	0,506822%			
h	Retención para Amortización de las Series A1, A2, B, C y D Series A1, A2, B, C & D Amortisation Withholding		10.10.2023	12.562.664,26	F - e		
i	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A1, A2, B, C y D Available Funds applied for Amortization of Series A1, A2, B, C & D.		10.10.2023	12.562.664,26			
j	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency		10.10.2023	0,00	h - i		

**1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue**

A	Saldo Principal Pendiente Clase A Outstanding Principal Balance Class A		17.07.2023	231.004.613,22			
A1	Saldo Principal Pendiente Serie A1 Outstanding Principal Balance Series A1		17.07.2023	0,00			
A2	Saldo Principal Pendiente Serie A2 Outstanding Principal Balance Series A2		17.07.2023	231.004.613,22			
B	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B		17.07.2023	7.310.562,56	(B / F)		2,891%
C	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C		17.07.2023	7.866.883,47	(C / F)		3,111%
D	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D		17.07.2023	6.691.023,70	(D / F)		2,646%
E	Saldo Principal Pendiente Serie E Outstanding Principal Balance Series E		17.07.2023	10.839.516,06			
F	Saldo Principal Pendiente Series A1, A2, B, C y D Outstanding Principal Balance Series A1, A2, B, C and D		17.07.2023	252.873.082,95			

**1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve**

m	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Precedente / Preceding	17.07.2023	10.300.000,00			
n	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Precedente / Preceding	17.07.2023	10.300.000,00	(n - m)		0,00
o	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Actual / Current	17.10.2023	10.300.000,00			
p	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Actual / Current	17.10.2023	10.300.000,00	(p - o)		0,00

**2 Situación disparadores / Triggers status**

Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Actúa S/N Breach Y/N
--------------------------	-----------------------	------------------------	-----------------------------------	-------------------------

**2.1 Amortización a Prorrata Clase A / Pro Rata Amortisation Class A**
**NO PROCEDE**
**2.2 Pago intereses Series B, C y D: postergación lugar orden de prelación  
Interest payment of Series B, C & D: place deferred in priority of payments**

2.2.1 Serie B / Series B	10.10.2023	i	> 98% * (B + C + D)	21.431.100,34	N
2.2.2 Serie C / Series C	10.10.2023	j	> 81% * (C + D)	11.791.904,81	N
2.2.3 Serie D / Series D	10.10.2023	i	> 69% * D	4.616.806,35	N

**2.3 Amortización a Prorrata Series B, C y D**

Pro Rata Amortisation of Series B, C &amp; D

**2.3.0 Condiciones comunes / Common conditions (\*)**

(i)	17.10.2023	(p - o)	= 0,00	0,00	S/Y
(ii)	10.10.2023	% (a / f)	≥ 10,00%	15,83%	S/Y

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

(i)	10.10.2023	% (B / F)	≥ 2,891%	2,891%	S/Y
(ii)	10.10.2023	% (b / e)	≤ 1,50%	0,278%	S/Y

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

(i)	10.10.2023	% (C / F)	≥ 3,111%	3,111%	S/Y
(ii)	10.10.2023	% (b / e)	≤ 1,25%	0,278%	S/Y

**2.3.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (\*)**

(i)	10.10.2023	% (D / F)	≥ 2,646%	2,646%	S/Y
(ii)	10.10.2023	% (b / e)	≤ 0,75%	0,278%	S/Y

**2.4 Reducción Fondo Reserva Requerido: condiciones (\*\*)**
**NO PROCEDE POR ESTAR EN EL MINIMO**

Required Cash Reserve reduction: conditions

(\*) Deben darse todas las condiciones / All conditions must concur

(\*\*) 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
10.10.2023	% (a / f)	< 10,00%	15,83%	N