

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

Actual / Current **19.04.2024**
 Actual / Current **12.04.2024**
 Precedente / Preceding **19.01.2024**
 Inicial **26.05.2006**

1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation		Fecha datos Data date	Valor / Importe Value / Amount	Cálculo Ratio Ratio calculation	Ratio (valor) Ratio (value)
1.1 Datos: Préstamos Hipotecarios / Data: Mortgage Loans					
a	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>	(b + c + d)	Actual 12.04.2024	108.250.028,75	
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>	(>3 y <18 meses) (>3 and <18 months)	Actual 12.04.2024	901.643,58	% (b / e) 0,848%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>	(≤ 3 meses) (≤3 months)	Actual 12.04.2024	105.456.722,43	
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	(≥18 meses) (≥18 months)	Actual 12.04.2024	1.891.662,74	
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos <i>Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans</i>	(<18 meses) (<18 months)	Actual 12.04.2024	106.358.366,01	% (e / i) 8,18%
f	Retención para Amortización de las Series A, B, C y D <i>Series A, B, C & D Amortisation Withholding</i>		Actual 19.04.2024	5.435.170,99	
g	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A, B, C y D <i>Available Funds applied for Amortization of Series A, B, C & D</i>		Currently	5.435.170,99	
h	Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i>			0,00	
i	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>		Initial 26.05.2006	1.300.020.570,99	
j	Margen medio Ponderado <i>Weighted average margin of Mortgage Loans</i>		19.04.2024	0,882474%	
1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue					
A	Saldo Principal Pendiente Serie A <i>Outstanding Principal Balance Series A</i>		Precedente 19.01.2024	101.310.595,48	
B	Saldo Principal Pendiente Serie B <i>Outstanding Principal Balance Series B</i>		Precedente 19.01.2024	5.712.033,60	% (B / F) 5,109%
C	Saldo Principal Pendiente Serie C <i>Outstanding Principal Balance Series C</i>		Precedente 19.01.2024	3.264.019,20	% (C / F) 2,920%
D	Saldo Principal Pendiente Serie D <i>Outstanding Principal Balance Series D</i>		Precedente 19.01.2024	1.506.888,72	% (D / F) 1,348%
E	Saldo Principal Pendiente Serie E <i>Outstanding Principal Balance Series E</i>		Precedente 19.01.2024	5.850.000,00	
F	Saldo Principal Pendiente Series A, B, C y D <i>Outstanding Principal Balance Series A, B, C & D</i>		Precedente 19.01.2024	111.793.537,00	
G	Importe nominal emisión Serie B <i>Issue face amount Series B</i>		Initial	27.300.000,00	
H	Importe nominal emisión Serie C <i>Issue face amount Series C</i>		Initial	15.600.000,00	
I	Importe nominal emisión Serie D <i>Issue face amount Series D</i>		Initial	7.200.000,00	
1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve					
K	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Precedente / Preceding 19.01.2024	5.850.000,00	
n	Fondo de Reserva Dotado		Precedente / Preceding	5.850.000,00	
ñ	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Actual / Current 19.04.2024	5.850.000,00	
o	Fondo de Reserva Dotado		Actual / Current	5.850.000,00	

2 Situación disparadores / Triggers status		Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Actúa S/N Breach Y/N
2.1 Pago intereses Series B, C y D: postergación lugar orden de prelación <i>Interest payment of Series B, C & D: place deferred in priority of payments</i>						
2.1.1	Serie B / Series B		h	> 0,5*B + C + D	7.626.924,72	N
(i) del cincuenta por ciento (50%) del importe nominal de emisión de los Bonos de la Serie B y						
(ii) del cien por ciento (100%) del importe nominal de emisión de los Bonos de las Series C y D						
2.1.2	Serie C / Series C		h	> 0,5*C + D	3.138.898,32	N
(i) del cincuenta por ciento (50%) del importe nominal de emisión de los Bonos de la Serie C y						
(ii) del cien por ciento (100%) del importe nominal de emisión de los Bonos de la Serie D						
2.1.3	Serie D / Series D		h	> 0,5*D	753.444,36	N
nominal de emisión de los Bonos de la Serie D						
NO APLICA POR ESTAR EN EL MÍNIMO						
2.2 Fondo de Reserva: <i>Cash Reserve</i>						
2.3 Amortización a Prorrata Series B, C y D <i>Pro Rata Amortisation of Series B, C & D</i>						
2.3.0 Condiciones comunes / Common conditions (**)						
(i)	que en la Fecha de Pago precedente a la Fecha de Pago correspondiente, el Fondo de Reserva hubiera sido dotado en el importe del Fondo de Reserva Requerido a aquella Fecha de Pago.		k-n	= 0,00	0,00	N S/Y
(ii)	en la Fecha Determinación precedente a la Fecha de Pago correspondiente, el importe del Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios no Dudosos sea igual o superior al 10 por 100 del Saldo Vivo inicial a la constitución del Fondo.			≥ 10,00%	8,18%	N
2.3.1 Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (**)						
(i)	el Saldo de Principal Pendiente de la Serie B sea igual o mayor al 4,200% de la suma del Saldo de Principal Pendiente de las Series A1, A2a, A2b, B, C y D,			≥ 4,200%	5,109%	S/Y S/Y
(ii)	el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 1,25% del Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios no Dudosos.			≤ 1,25%	0,848%	S/Y
2.3.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (**)						
(i)	el Saldo de Principal Pendiente de la Serie C sea igual o mayor al 2,400% de la suma del Saldo de Principal Pendiente de las Series A1, A2a, A2b, B, C y D			≥ 2,400%	2,920%	S/Y S/Y
(ii)	el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 1,00% del Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios no Dudosos.			≤ 1,00%	0,848%	S/Y
2.3.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (**)						
(i)	el Saldo de Principal Pendiente de la Serie D sea igual o mayor al 1,108% de la suma del Saldo de Principal Pendiente de las Series A1, A2a, A2b, B, C y D,			≥ 1,108%	1,348%	N S/Y
(ii)	el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 0,75% del Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios no Dudosos.			≤ 0,75%	0,848%	N

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

Amortización Anticipada opcional / Optional Early Amortization

Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición / Condition	Valor Disparador Trigger value	Opción ejercitable S/N Exercisable Option Y/N
26/05/2006	% (a / i)	< 10,00%	8,33%	S/Y