

Fecha de Pago / Payment Date	Actual / Current	27.12.2022
Fecha de Determinación / Determination Date	Actual / Current	20.12.2022
Fecha de Pago / Payment Date	Precedente / Preceding	26.09.2022
Fecha constitución Fondo / Fund establishment date		02.02.2006

1	Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation	Fecha datos Date 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>		293.612.628,48			
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>	20.12.2022	3.120.537,14	% (b / e)	1,149%	
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>	20.12.2022	268.385.779,70			
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	20.12.2022	22.106.311,64			
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos <i>Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans</i>	20.12.2022	271.506.316,84	% (e / g)	13,57%	
f	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>	02.02.2006	2.000.095.452,90			
g	Margen medio ponderado de Préstamos Hipotecarios <i>Weighted average margin of Mortgage Credits</i>	20.12.2022	0,908160%			
h	Retención para Amortización de las Series A1, A2, B, C y D <i>Series A1, A2, B, C & D Amortisation Withholding</i>	20.12.2022	11.260.003,16	F - e		
i	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A1, A2, B, C y D <i>Available Funds applied for Amortization of Series A1, A2, B, C & D</i>	20.12.2022	11.260.003,16			
j	Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i>	27.12.2022	0,00	h - i		
1.2	Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue					
A	Saldo Principal Pendiente Clase A <i>Outstanding Principal Balance Class A</i>	26.09.2022	182.766.320,00			
A1	Saldo Principal Pendiente Serie A1 <i>Outstanding Principal Balance Series A1</i>	26.09.2022	0,00			
A2	Saldo Principal Pendiente Serie A2 <i>Outstanding Principal Balance Series A2</i>	26.09.2022	182.766.320,00			
B	Saldo Principal Pendiente Serie B <i>Outstanding Principal Balance Series B</i>	26.09.2022	52.000.000,00	% (B / F)	18,390%	
C	Saldo Principal Pendiente Serie C <i>Outstanding Principal Balance Series C</i>	26.09.2022	25.000.000,00	% (C / F)	8,841%	
D	Saldo Principal Pendiente Serie D <i>Outstanding Principal Balance Series D</i>	26.09.2022	23.000.000,00	% (D / F)	8,134%	
E	Saldo Principal Pendiente Serie E <i>Outstanding Principal Balance Series E</i>	26.09.2022	22.600.000,00			
F	Saldo Principal Pendiente Series A1, A2, B, C y D <i>Outstanding Principal Balance Series A1, A2, B, C and D</i>	26.09.2022	282.766.320,00			
1.3	Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve					
k	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	26.09.2022	22.600.000,00			
l	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	26.09.2022	15.372.145,06	(l - k)	-7.227.854,94	
m	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	27.12.2022	22.600.000,00			
n	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	27.12.2022	17.782.457,73	(n - m)	-4.817.542,27	
2	Situación disparadores / Triggers status	Fecha datos Date 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	27.12.2022	j	> (85% * B) + C + D	92.200.000,00	N
2.1.2	Serie C / Series C	27.12.2022	j	> (85% * C) + D	44.250.000,00	N
2.1.3	Serie D / Series D	27.12.2022	j	> 85% * D	19.550.000,00	N
2.2	Amortización a Prorrata Series B, C y D <i>Pro Rata Amortisation of Series B, C & D</i>					
2.2.0	Condiciones comunes / Common conditions (*)					
(i)	Fondo Reserva Requerido = Fondo Reserva Dotado	27.12.2022	(n - m)	= 0,00	-4.817.542,27	N
(ii)	Saldo vivo \geq 10% Saldo Inicial Fondo	27.12.2022	% (a / f)	\geq 10,00%	14,68%	S/Y
2.2.1	Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (*)					
(i)	Serie B \geq 5,20% de Saldo Series A1, A2, B, C y D	20.12.2022	% (B / F)	\geq 5,200%	18,390%	S/Y
(ii)	Saldo vivo Morosos \leq 1,25% de Saldo vivo no dudosos	20.12.2022	% (b / e)	\leq 1,25%	1,149%	S/Y
2.2.2	Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (*)					
(i)	Serie C \geq 2,50% de Saldo Series A1, A2, B, C y D	20.12.2022	% (C / F)	\geq 2,500%	8,841%	S/Y
(ii)	Saldo vivo Morosos \leq 1,00% de Saldo vivo no dudosos	20.12.2022	% (b / e)	\leq 1,00%	1,149%	N
2.2.3	Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (*)					
(i)	Serie D \geq 2,30% de Saldo Series A1, A2, B, C y D	20.12.2022	% (D / F)	\geq 2,300%	8,134%	S/Y
(ii)	Saldo vivo Morosos \leq 0,75% de Saldo vivo no dudosos	20.12.2022	% (b / e)	\leq 0,75%	1,149%	N
2.3	Fondo de Reserva; <i>Cash Reserve:</i>					N
2.3.1	Condiciones de reducción: <i>Conditions Cash Reserve reduction:</i>	27.12.2022	% m/(F-(E-e))	> 2,26%	8,324%	S/Y
2.3.2	Condiciones de no reducción (solo aplica si 2.4.1 es S/Y) (**) <i>Conditions Cash Reserve reduction (only applicable if 2.4.1 is S/Y)(**)</i>					S/Y
(i)	Saldo Vivo Morosos > 1% Saldo Vivo no Dudosos	20.12.2022	% (b / e)	> 1,00%	1,149%	S/Y
(ii)	No se pudiera dotar el Fondo Reserva Requerido en FP anterior	26.09.2022	(l - k)	< 0,00	-7.227.854,94	S/Y
(iii)	Margen medio Indices Ref por Ppal Pte \leq 0,60%	20.12.2022	g	\leq 0,600%	0,908%	N
(iv)	No hayan pasado 3 años desde Constitución Fondo	27.12.2022	02.02.2006	años/years < 3,00	16,91	N

(*) 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 Date date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Opción ejercitable S/N Exercisable Option Y/N
		20.12.2022	% (a / g)	< 10,00%	14,68%	N