

**I. DATOS IDENTIFICATIVOS**

Denominación del Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION  
Número de registro del Fondo: 202100003  
NIF Fondo: V05377221  
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: NO  
Fecha: 30/09/2023

**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)

**Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2023**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	16.868	1001	13.788
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	15.347	1002	12.267
1. Activos titulizados	0003	15.347	1003	12.267
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	0	1005	0
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007	0	1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008	0	1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009	0	1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010	0	1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016	13.351	1016	12.202
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	0
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022	0	1022	0
1.20 Otros	0023	0	1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	2.556	1025	87
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-560	1027	-22
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039	0	1039	0
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0040	1.521	1040	1.521

**Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2023**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	3.226	1041	12.966
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	0	1042	0
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	340	1043	7.848
1. Activos titulizados	0044	178	1044	7.720
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	0	1046	0
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048	0	1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049	0	1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050	0	1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051	0	1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052	0	1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053	0	1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054	0	1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055	0	1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056	0	1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057	0	1057	7.188
1.14 Préstamos automoción	0058	0	1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060	0	1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061	0	1061	0
1.18 Bonos de titulización	0062	0	1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063	0	1063	0
1.20 Otros	0064	0	1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	118	1065	123
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	61	1066	19
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	0	1067	886
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	0	1068	42
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	0	1069	-538
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	162	1074	128
3.1 Valores representativos de deuda	0075	0	1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076	0	1076	0
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	162	1077	128
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081	0	1081	0
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0082		1082	
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
<b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b>	0085	2.886	1085	5.118
1. Tesorería	0086	2.886	1086	5.118
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	20.094	1088	26.755

**Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2023**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	19.849	1089	26.527
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0090		1090	
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	0	1092	0
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0094	19.849	1094	26.527
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	19.849	1095	26.527
1.1 Series no subordinadas	0096	26.200	1096	32.200
1.2 Series subordinadas	0097	0	1097	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	-6.351	1098	-5.673
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101		1101	
2.1 Préstamo subordinado	0102	0	1102	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108		1108	
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0116	0	1116	0

**Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2023**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	245	1117	228
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0118	0	1118	0
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0123	93	1123	74
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	60	1124	74
1.1 Series no subordinadas	0125	0	1125	0
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	60	1128	74
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	33	1131	
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	33	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	0	1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	0	1136	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139		1139	
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	0
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143		1143	
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	152	1148	154
1. Comisiones	0149	5	1149	4
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	5	1150	4
1.2 Comisión administrador	0151	54	1151	6
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-54	1155	-6
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	147	1157	150
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158		1158	
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159	0	1159	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	0	1160	0
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161	0	1161	0
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	20.094	1162	26.755

**Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2023**

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	543	1201	575	2201	1.406	3201	1.688
1.1 Activos titulizados	0202	543	1202	575	2202	1.406	3202	1.688
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-345	1204	-333	2204	-1.047	3204	-948
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-345	1205	-333	2205	-1.047	3205	-948
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	0	1206	0	2206	0	3206	0
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	0	1208	0	2208	0	3208	0
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	198	1209	243	2209	359	3209	740
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0210		1210		2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-104	1217	-65	2217	-262	3217	-193
7.1 Servicios exteriores	0218	-36	1218	-2	2218	-68	3218	-6
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-36	1219	-2	2219	-68	3219	-6
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-68	1224	-63	2224	-194	3224	-187
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-30	1225	-26	2225	-80	3225	-77
7.3.2 Comisión administrador	0226	-38	1226	-36	2226	-113	3226	-109
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227	0	3227	0
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	-1	3230	-1
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	-315	1231	-83	2231	-823	3231	-622
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-315	1232	-83	2232	-823	3232	-622
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0234		1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236	0	3236	0
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0238	0	1238	0	2238	0	3238	0
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	221	1239	-95	2239	726	3239	75
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0240	0	1240		2240		3240	0
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

**Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2023**

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	145	1300	378	2300	363	3300	831
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	263	1301	442	2301	579	3301	1.027
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	553	1302	714	2302	1.448	3302	1.805
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-290	1303	-272	2303	-869	3303	-778
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-82	1309	-64	2309	-145	3309	-189
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-30	1310	-27	2310	-79	3310	-79
2.2 Comisión administrador	0311	-52	1311	-37	2311	-65	3311	-110
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	-1	3312	-1
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>	0315	-35	1315	0	2315	-71	3315	-7
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-35	1320	0	2320	-71	3320	-7
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	-3.928	1322	1.441	2322	-2.596	3322	2.712
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	0323	0	1323	2.000	2323	0	3323	3.000
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	0324	-1.467	1324	-4.143	2324	-5.379	3324	-11.866
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	0325	-2.399	1325	3.640	2325	2.942	3325	11.741
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	1.489	1326	1.414	2326	3.775	3326	4.720
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.704	1327	1.865	2327	4.026	3327	5.697
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	288	1328	194	2328	817	3328	622
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	120	1329	168	2329	324	3329	702
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-6.000	1331	0	2331	-6.000	3331	0
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	-63	1332	-56	2332	-159	3332	-162
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	33	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	-66	1335	-56	2335	-192	3335	-162
7.4 Otros cobros y pagos	0336	4	1336	0	2336	0	3336	0
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	-3.783	1337	1.819	2337	-2.232	3337	3.543
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	6.669	1338	3.317	2338	5.118	3338	1.593
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	2.886	1339	5.136	2339	2.886	3339	5.136

**Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2023**

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
<b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>								
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	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>0356</b>		<b>1356</b>		<b>2356</b>		<b>3356</b>	
<b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>								
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	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>0363</b>		<b>1363</b>		<b>2363</b>		<b>3363</b>	
<b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>								
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	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>0369</b>		<b>1369</b>		<b>2369</b>		<b>3369</b>	
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>0370</b>		<b>1370</b>		<b>2370</b>		<b>3370</b>	



Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2023								Situación cierre anual anterior 31/12/2022								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	16,07	0412	8,60	0432	8,27	0452	15,96	1392	4,78	1412	21,26	1432	12,61	1452	18,42	2392	2,63	2412	0,00	2432	0,00	2452	0,00
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		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
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: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: NEXTGEN FINANCIAL SERVICES 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	426	0467	50	0474	15	0481	0	0488	65	0495	1.347	0502	0	0509	1.412
De 1 a 3 meses	0461	199	0468	38	0475	11	0482	0	0489	49	0496	505	0503	0	0510	554
De 3 a 6 meses	0462	246	0469	72	0476	12	0483	7	0490	91	0497	604	0504	0	0511	695
De 6 a 9 meses	0463	296	0470	160	0477	15	0484	22	0491	197	0498	556	0505	0	0512	753
De 9 a 12 meses	0464	337	0471	224	0478	25	0485	44	0492	293	0499	939	0506	0	0513	1.232
Más de 12 meses	0465		0472		0479		0486	0	0493		0500		0507	0	0514	
<b>Total</b>	0466	<b>1.504</b>	0473	<b>544</b>	0480	<b>77</b>	0487	<b>73</b>	0494	<b>694</b>	0501	<b>3.953</b>	0508		1515	<b>4.647</b>

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	
<b>Total</b>	0521		0528		0535		0542		0549		0556		0563		0570		0577				0590	

S.05.1

**Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2023**

**Entidades cedentes de los activos titulizados: NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.**

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO C**

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 08/04/2021	
Inferior a 1 año	0600	565	1600	1.703	2600	5.150
Entre 1 y 2 años	0601	2.482	1601	3.632	2601	6.233
Entre 2 y 3 años	0602	2.535	1602	3.214	2602	8.806
Entre 3 y 4 años	0603	7.963	1603	7.846	2603	16.454
Entre 4 y 5 años	0604	2.263	1604	3.897	2604	13.157
Entre 5 y 10 años	0605	98	1605	72	2605	5.992
Superior a 10 años	0606		1606		2606	
<b>Total</b>	0607	<b>15.907</b>	1607	<b>20.364</b>	2607	<b>55.792</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>3,06</b>	1608	<b>2,92</b>	2608	<b>3,18</b>

Antigüedad	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 08/04/2021	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	1,40	1609	1,20	2609	0,68

S.05.1

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO D**

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 08/04/2021			
	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	
<b>Total</b>	0628		0638		1628		1638		2628		2638	
<b>Media ponderada (%)</b>	0639		0649		1639		1649		2639		2649	

**WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

S.05.1

**Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2023**

**Entidades cedentes de los activos titulizados: NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.**

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 08/04/2021	
	Tipo de interés medio ponderado	0650	10,80	1650	10,74	2650
Tipo de interés nominal máximo	0651	18,46	1651	24,66	2651	24,66
Tipo de interés nominal mínimo	0652	4,81	1652	4,81	2652	4,81

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/09/2023</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO F**

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 08/04/2021			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	860	0683	1.844	1660	959	1683	2.450	2660	2.564	2683	7.503
Aragón	0661	168	0684	448	1661	166	1684	605	2661	480	2684	1.546
Asturias	0662	67	0685	228	1662	69	1685	244	2662	174	2685	613
Baleares	0663	218	0686	547	1663	211	1686	736	2663	627	2686	1.991
Canarias	0664	343	0687	830	1664	348	1687	1.063	2664	864	2687	2.864
Cantabria	0665	67	0688	173	1665	64	1688	178	2665	210	2688	622
Castilla-León	0666	174	0689	390	1666	177	1689	448	2666	542	2689	1.506
Castilla La Mancha	0667	238	0690	520	1667	246	1690	671	2667	744	2690	1.999
Cataluña	0668	1.265	0691	3.508	1668	1.303	1691	4.417	2668	3.548	2691	11.775
Ceuta	0669	14	0692	23	1669	14	1692	32	2669	56	2692	124
Extremadura	0670	69	0693	166	1670	68	1693	187	2670	195	2693	557
Galicia	0671	190	0694	575	1671	189	1694	713	2671	481	2694	1.691
Madrid	0672	1.415	0695	3.839	1672	1.528	1695	5.120	2672	4.388	2695	13.502
Melilla	0673	8	0696	29	1673	8	1696	30	2673	30	2696	109
Murcia	0674	188	0697	466	1674	197	1697	585	2674	475	2697	1.446
Navarra	0675	62	0698	171	1675	57	1698	150	2675	159	2698	540
La Rioja	0676	28	0699	55	1676	31	1699	82	2676	110	2699	265
Comunidad Valenciana	0677	609	0700	1.606	1677	627	1700	1.987	2677	1.670	2700	5.381
País Vasco	0678	187	0701	488	1678	208	1701	665	2678	610	2701	1.757
<b>Total España</b>	0679	<b>6.170</b>	0702	<b>15.907</b>	1679	<b>6.470</b>	1702	<b>20.364</b>	2679	<b>17.927</b>	2702	<b>55.792</b>
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680		2703	
Resto	0681		0704		1681		1704		2681		2704	
<b>Total general</b>	0682	<b>6.170</b>	0705	<b>15.907</b>	1682	<b>6.470</b>	1705	<b>20.364</b>	2682	<b>17.927</b>	2705	<b>55.792</b>

**WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/09/2023</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 30/09/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 08/04/2021			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,92			1710	2,25			2710	0,95		
Sector	0711		0712	-	1711		1712		2711		2712	-

S.05.2

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos:

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 08/04/2021					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
	BONOS	262	100.000	26.200	322	100.000	32.200	322	100.000	32.200			
<b>Total</b>		0723	262	0724	26.200	1723	322	1724	32.200	2723	322	2724	32.200



<b>S.05.2</b>
<b>Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Periodo de la declaración: 30/09/2023</b>
<b>Mercados de cotización de los valores emitidos:</b>

**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							
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738		0739				
	BONOS	NS	FIJO	0,00	4,40	60	0	SI	26.200	0	26.260		-6.351				
<b>Total</b>						0740	60	0741	0	0743	26.200	0744	0	0745	26.260	0746	-6.351

	Situación actual 30/09/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 08/04/2021			
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	4,40	0748	4,40	0749	4,20

<b>S.05.2</b>
<b>Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Periodo de la declaración: 30/09/2023</b>
<b>Mercados de cotización de los valores emitidos:</b>

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO C**

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2023								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2022							
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	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
	BONOS	6.000	6.000	290	2.533	0	0	272	1.374								
<b>Total</b>		0754	6.000	0755	6.000	0756	290	0757	2.533	1754	0	1755	0	1756	272	1757	1.374

**WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

<b>S.05.2</b>
<b>Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Periodo de la declaración: 30/09/2023</b>
<b> Mercados de cotización de los valores emitidos:</b>

**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 30/09/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 08/04/2021
		0760	0761	0762	0763	0764

S.05.2

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2023

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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 08/04/2021	
Inferior a 1 año	0765		1765		2765	
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	
Entre 5 y 10 años	0770	26.200	1770	32.200	2770	32.200
Superior a 10 años	0771		1771		2771	
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>26.200</b>	<b>1772</b>	<b>32.200</b>	<b>2772</b>	<b>32.200</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>7,44</b>	<b>1773</b>	<b>8,19</b>	<b>2773</b>	<b>9,72</b>

**Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2023**

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 08/04/2021	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	262	1775	322	2775	322
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	262	1776	322	2776	322
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	1,00	1777	1,00	2777	1,00
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.	1778	NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.	2778	NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.
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: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

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 30/09/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 08/04/2021			
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806		
Total						0808		0809		0810	

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

**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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 08/04/2021		Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 08/04/2021			
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 titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
<b>Total</b>	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

<b>S.05.4</b>
<b>Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/09/2023</b>

**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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002		7003		7006		7009		7012		7015			
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005		7008		7011		7014		7017		7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	3	7020		7021	13.104	7024	10.339	7027	50,00	7030	34,76	7033	37,93		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022		7025		7028		7031		7034			
Total Fallidos					7023	13.104	7026	10.339	7029	50,00	7032	34,76	7035	37,93	7036	ESCRITUR A DE CONSTRU CION. ANEXO 1

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853



S.05.4

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

**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

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

**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	2	2862	VNP MEDIO DC	3862	0,250	4862	90	5862		6862	MENSUAL	7862	S	8862	EL IMPORTE MÁXIMO ES ANUALMENTE
Comisión administrador	0863	NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.	1863		2863	VNP MEDIO DC	3863	1,350	4863		5863		6863	MENSUAL	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	EBN BANCO DE NEGOCIOS, S.A.	1864		2864		3864		4864		5864		6864	MENSUAL	7864	S	8864	EN FUNCIÓN DEL NÚMERO DE TRANSFERENCIAS
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865	MENSUAL	7865	S	8865	

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

**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	NEXTGEN FINANCIAL SERVICES 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		
		31/01/2023	28/02/2023	31/03/2023	30/04/2023	31/05/2023	30/06/2023	31/07/2023	31/08/2023	30/09/2023				
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872													
Margen de intereses	0873	-27	-75	128	21	14	100	43	100	54				359
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	-117	-85	-77	-72	-106	-51	-40	-107	-168				-823
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	-22	-21	-23	-22	-51	-19	-38	-20	-45				-262
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	-167	-180	28	-74	-143	30	-35	-27	-159				-726
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879													
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880													
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881													
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	167	180	-28	74	143	-30	35	27	159				726
Comisión variable pagada	0883													
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884													

<b>S.05.5</b>
<b>Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/09/2023</b>

**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: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2023**

**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**