

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

Actual / Current **17.02.2022**
 Actual / Current **10.02.2022**
 Precedente / Preceding **17.11.2021**
 Precedente / Preceding **28.03.2007**

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 <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>	(b + c + d)	Actual Currently	10.02.2022 289.080.039,55		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>	(>3 y <18 meses)	Actual Currently	10.02.2022 2.314.174,36	% (b / e)	0,833%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>	(≤ 3 meses)	Actual Currently	10.02.2022 275.394.858,55		
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	(≥18 meses)	Actual Currently	10.02.2022 11.371.006,64		
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos <i>Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans</i>	(<18 meses)	Actual Currently	10.02.2022 277.709.032,91	% (e / f)	18,51%
f	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>		Inicial Initial	28.03.2007 1.500.118.980,94		
g	Retención para Amortización de las Series A, B, C y D <i>Series A, B, C & D Amortisation Withholding</i>	(F - e)	Actual Currently	17.02.2022 11.291.657,60		
h	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A, B, C y D <i>Available Funds applied for Amortization of Series A, B, C & D</i>		Actual Currently	17.02.2022 0,00		
i	Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i>		Actual Currently	10.02.2022 81.004.311,86		
j	Saldo Vivo Acumulado de los Préstamos Dudosos <i>Accumulated Outstanding Balance of Doubtful Loans</i>		Actual Currently	10.02.2022 11.186.154,70		
k	Ingresos percibidos por reembolso de principal <i>Income received from repayment of principal</i>		Actual Currently			

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Serie A <i>Outstanding Principal Balance Series A</i>		Precedente Preceding	17.11.2021 255.595.099,39		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B <i>Outstanding Principal Balance Series B</i>		Precedente Preceding	17.11.2021 13.836.936,72	% (B / F)	4,788%
C	Saldo Principal Pendiente Serie C <i>Outstanding Principal Balance Series C</i>		Precedente Preceding	17.11.2021 13.838.100,90	% (C / F)	4,788%
D	Saldo Principal Pendiente Serie D <i>Outstanding Principal Balance Series D</i>		Precedente Preceding	17.11.2021 5.730.553,50	% (D / F)	1,983%
E	Saldo Principal Pendiente Serie E <i>Outstanding Principal Balance Series E</i>		Precedente Preceding	17.11.2021 7.500.000,00		
F	Saldo Principal Pendiente Series A, B, C y D. <i>Outstanding Principal Balance Series A, B, C & D.</i>		Precedente Preceding	17.11.2021 289.000.690,51		
G	Importe nominal emisión Serie A <i>Issue face amount Series A</i>		Inicial Initial	28.03.2007 1.431.700.000,00		
H	Importe nominal emisión Serie B <i>Issue face amount Series B</i>		Inicial Initial	28.03.2007 29.300.000,00		
I	Importe nominal emisión Serie C <i>Issue face amount Series C</i>		Inicial Initial	28.03.2007 28.500.000,00		
J	Importe nominal emisión Serie D <i>Issue face amount Series D</i>		Inicial Initial	28.03.2007 10.500.000,00		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

l	Fondo de Reserva Requerido / <i>Required Cash Reserve</i>		Precedente / Preceding	17.11.2021 7.500.000,00		
m	Fondo de Reserva Dotado / <i>Provisioned Cash Reserve</i>		Precedente / Preceding	7.500.000,00		
n	Fondo de Reserva Requerido / <i>Required Cash Reserve</i>		Actual / Currently	17.02.2022 7.500.000,00		
ñ	Fondo de Reserva Dotado / <i>Provisioned Cash Reserve</i>		Actual / Currently	7.500.000,00		

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	10.02.2022	Serie B / <i>Series B</i>	Saldo Vivo Ptmos Dudosos	(i/f) > 8,00%	5,40% N
2.1.2	10.02.2022	Serie C / <i>Series C</i>	Saldo Vivo Ptmos Dudosos	(i/f) > 5,20%	5,40% S/N
2.1.3	10.02.2022	Serie D / <i>Series D</i>	Saldo Vivo Ptmos Dudosos	(i/f) > 4,50%	5,40% S/N
2.2 Fondo de Reserva: <i>Cash Reserve</i>					
NO APLICA POR ESTAR EN EL MÍNIMO					
2.3	10.02.2022	Amortización a Prorrata Clase A	(c+k)/A	< 1,00%	1,12 N
2.4 Amortización a Prorrata Series B, C y D <i>Pro Rata Amortisation of Series B, C & D</i>					
2.4.0 Condiciones comunes / Common conditions (**)					
(i)	10.02.2022	No procede 2.3		N	S/N
(ii)	17.02.2022	Fondo de Reserva en F.P. = Fondo de Reserva requerido		= 0,00	0,00 S/N
(iii)	10.02.2022	Saldo Vivo Ph's no Dudosos > 10% Aldo Vivo inicial		≥ 10,00%	18,51% S/N
2.4.1 Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (**)					
(i)	10.02.2022	el Saldo de Principal Pendiente de la Serie B sea igual o mayor al 3,907%		≥ 3,907%	4,788% S/N
(ii)	10.02.2022	el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,25%		≤ 1,25%	0,833% S/N
2.4.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (**)					
(i)	10.02.2022	el Saldo de Principal Pendiente de la Serie C sea igual o mayor al 3,800%		≥ 3,800%	4,788% S/N
(ii)	10.02.2022	el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,00%		≤ 1,00%	0,833% S/N
2.4.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (**)					
(i)	10.02.2022	el Saldo de Principal Pendiente de la Serie D sea igual o mayor al 1,400% de la suma del		≥ 1,400%	1,983% N
(ii)	10.02.2022	el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 0,75%		≤ 0,75%	0,833% 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
28/03/2007	% (a / g)	< 10,00%	19,27%	N