

Fecha de Pago / Payment Date	Actual / Current	17.01.2024
Fecha de Determinación / Determination Date	Actual / Current	11.01.2024
Fecha de Pago / Payment Date	Precedente / Preceding	17.10.2023
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		230.855.214,45 %	14,90%
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <18 meses)	11.01.2024	833.108,64		% (b / e)	0,368%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Do)	(≤ 3 meses)	11.01.2024	225.355.454,30			
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥ 18 meses)	11.01.2024	4.666.651,51			
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<18 meses)	11.01.2024	226.188.562,94		% (e / f)	14,60%
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		11.01.2024	0,505671%			
h	Retención para Amortización de las Series A1, A2, B, C y D Series A1, A2, B, C & D Amortisation Withholding		11.01.2024	14.121.959,95	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.		11.01.2024	14.121.959,95			
j	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency		11.01.2024	0,00	h - i		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase A Outstanding Principal Balance Class A		17.10.2023	219.528.465,72			
A1	Saldo Principal Pendiente Serie A1 Outstanding Principal Balance Series A1		17.10.2023	0,00			
A2	Saldo Principal Pendiente Serie A2 Outstanding Principal Balance Series A2		17.10.2023	219.528.465,72			
B	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B		17.10.2023	6.947.377,92	(B / F)		2,891%
C	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C		17.10.2023	7.476.061,00	(C / F)		3,111%
D	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D		17.10.2023	6.358.618,25	(D / F)		2,646%
E	Saldo Principal Pendiente Serie E Outstanding Principal Balance Series E		17.10.2023	10.349.627,46			
F	Saldo Principal Pendiente Series A1, A2, B, C y D Outstanding Principal Balance Series A1, A2, B, C and D		17.10.2023	240.310.522,89			

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Precedente / Preceding	17.10.2023	10.300.000,00			
n	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Precedente / Preceding	17.10.2023	10.300.000,00	(n - m)		0,00
o	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Actual / Current	17.01.2024	10.300.000,00			
p	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Actual / Current	17.01.2024	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

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	11.01.2024	i	> 98% * (B + C + D)	20.366.416,03	N
2.2.2 Serie C / Series C	11.01.2024	j	> 81% * (C + D)	11.206.090,19	N
2.2.3 Serie D / Series D	11.01.2024	i	> 69% * D	4.387.446,59	N

2.3 Amortización a Prorrata Series B, C y D

Pro Rata Amortisation of Series B, C & D

2.3.0 Condiciones comunes / Common conditions (*)

(i)	17.01.2024	(p - o)	= 0,00	0,00	S/Y
(ii)	11.01.2024	% (a / f)	≥ 10,00%	14,90%	S/Y

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

(i)	11.01.2024	% (B / F)	≥ 2,891%	2,891%	S/Y
(ii)	11.01.2024	% (b / e)	≤ 1,50%	0,368%	S/Y

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

(i)	11.01.2024	% (C / F)	≥ 3,111%	3,111%	S/Y
(ii)	11.01.2024	% (b / e)	≤ 1,25%	0,368%	S/Y

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

(i)	11.01.2024	% (D / F)	≥ 2,646%	2,646%	S/Y
(ii)	11.01.2024	% (b / e)	≤ 0,75%	0,368%	S/Y

2.4 Reducción Fondo Reserva Requerido: condiciones ()**

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
11.01.2024	% (a / f)	< 10,00%	14,90%	N