

## ANEXO I

El balance inmediatamente anterior a la fecha en la que se decidió la liquidación del Fondo es como sigue:

	<u>Miles de euros</u> <u>2023</u>
<b>ACTIVO</b>	
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	-
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	-
Activos titulizados	-
Certificados de transmisión de hipoteca	-
Activos dudosos -principal-	-
Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	-
<b>II. Activos por impuestos diferido</b>	-
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	-
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	<b>134.403</b>
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	-
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	<b>132.711</b>
Activos titulizados	132.711
Certificados de transmisión de hipoteca	135.358
Intereses y gastos devengados no vencidos	-
Intereses vencidos e impagados	-
Activos dudosos -principal-	-
Activos dudosos -intereses y otros-	(8)
Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	(2.639)
Otros activos financieros	-
Deudores y otras cuentas a cobrar	-
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	-
Otros	-
<b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b>	<b>1.692</b>
Tesorería	1.692
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b><u>134.403</u></b>

	<u>Miles de euros</u>
	<u>2023</u>
<b>PASIVO</b>	
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	-
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	-
Provisión por margen de intermediación	-
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	-
Obligaciones y otros valores emitidos	-
Series no subordinadas	-
<b>III. Pasivo por impuesto diferido</b>	-
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	<b>134.403</b>
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	-
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	-
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	<b>132.540</b>
Obligaciones y otros valores emitidos	132.540
Series no subordinadas	133.835
Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	(1.295)
Otros pasivos financieros	-
Otros	-
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	<b>1.863</b>
Comisiones	(7)
Comisión sociedad gestora	-
Comisión administrador	(6)
Comisión agente financiero/pagos	-
Otros	1.870
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	-
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	-
<b>IX. Cobertura de flujos de efectivo</b>	-
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos /pérdidas reconocidos</b>	-
<b>TOTAL PASIVO</b>	<b><u>134.403</u></b>

## ANEXO II

El estado de flujos de efectivo del período comprendido entre la fecha inmediatamente anterior a la fecha en la que se decidió la liquidación del Fondo y la fecha de cierre del ejercicio es el siguiente:

	Miles de euros
	2023
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN</b>	<b>(1.516)</b>
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	<b>(1.373)</b>
Intereses cobrados de los activos titulizados	19.323
Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	(20.696)
Pagos por operaciones de derivados de cobertura	-
Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	-
Otros intereses cobrados/pagados (neto)	-
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	<b>(143)</b>
Comisión sociedad gestora	(6)
Comisión variable	(135)
Comisión agente financiero/pagos	(2)
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>	<b>-</b>
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSIÓN/ FINANCIACIÓN</b>	<b>(1.912)</b>
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	<b>-</b>
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	<b>-</b>
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	<b>(1.741)</b>
Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	-
Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	132.094
Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	-
Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	(133.835)
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	<b>(171)</b>
Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	-
Otros cobros y pagos	(171)
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	<b>(3.428)</b>
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo.	3.428
Efectivo o equivalentes al final del periodo.	-