

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

Actual / Current **19.02.2024**
 Actual / Current **12.02.2024**
 Precedente / Preceding **17.11.2023**
 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 12.02.2024 204.872.890,15 Currently		
b Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>	(>3 y <18 meses) (>3 and <18 months) Actual 12.02.2024 2.154.708,50 Currently	% (b / e)	1,073%
c Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>	(≤ 3 meses) (≤3 months) Actual 12.02.2024 198.627.659,29 Currently		
d Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	(≥18 meses) (≥18 months) Actual 12.02.2024 4.090.522,36 Currently		
e Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos <i>Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans</i>	(<18 meses) (<18 months) Actual 12.02.2024 200.782.367,79 Currently	% (e / f)	13,38%
f Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>	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 19.02.2024 9.482.500,04 Currently		
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 19.02.2024 9.482.500,04 Currently		
i Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i>	Actual 19.02.2024 0,00 Currently		
j Saldo Vivo Acumulado de los Préstamos Dudosos <i>Accumulated Outstanding Balance of Doubtful Loans</i>	Actual 12.02.2024 75.496.580,40 Currently		
k Ingresos percibidos por reembolso de principal <i>Income received from repayment of principal</i>	Actual 12.02.2024 9.752.326,04 Currently		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A Saldo Principal Pendiente Serie A <i>Outstanding Principal Balance Series A</i>	Precedente 17.11.2023 191.116.044,00 Preceding		
B Saldo Principal Pendiente Serie B <i>Outstanding Principal Balance Series B</i>	Precedente 17.11.2023 8.215.049,03 Preceding	% (B / F)	3,907%
C Saldo Principal Pendiente Serie C <i>Outstanding Principal Balance Series C</i>	Precedente 17.11.2023 7.990.066,20 Preceding	% (C / F)	3,800%
D Saldo Principal Pendiente Serie D <i>Outstanding Principal Balance Series D</i>	Precedente 17.11.2023 2.943.708,60 Preceding	% (D / F)	1,400%
E Saldo Principal Pendiente Serie E <i>Outstanding Principal Balance Series E</i>	Precedente 17.11.2023 7.500.000,00 Preceding		
F Saldo Principal Pendiente Series A, B, C y D. <i>Outstanding Principal Balance Series A, B, C & D.</i>	Precedente 17.11.2023 210.264.867,83 Preceding		
G Importe nominal emisión Serie A <i>Issue face amount Series A</i>	Inicial 28.03.2007 1.431.700.000,00 Initial		
H Importe nominal emisión Serie B <i>Issue face amount Series B</i>	Inicial 28.03.2007 29.300.000,00 Initial		
I Importe nominal emisión Serie C <i>Issue face amount Series C</i>	Inicial 28.03.2007 28.500.000,00 Initial		
J Importe nominal emisión Serie D <i>Issue face amount Series D</i>	Inicial 28.03.2007 10.500.000,00 Initial		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

l Fondo de Reserva Requerido / <i>Required Cash Reserve</i>	Precedente / Preceding 17.11.2023 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 19.02.2024 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
2.1 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

Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Actúa S/N Breach Y/N
2.1.1 Serie B / Series B	Saldo Vivo Ptmos Dudosos	(j/f) > 8,00%	5,03%	N
2.1.2 Serie C / Series C	Saldo Vivo Ptmos Dudosos	(j/f) > 5,20%	5,03%	N
2.1.3 Serie D / Series D	Saldo Vivo Ptmos Dudosos	(j/f) > 4,50%	5,03%	S/Y

2.2 Fondo de Reserva:

Cash Reserve

NO APLICA POR ESTAR EN EL MÍNIMO

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) No procede 2.3	12.02.2024	2.3	N		S/Y
(ii) Fondo de Reserva en F.P. = Fondo de Reserva requerido	19.02.2024		= 0,00	0,00	S/Y
(iii) Saldo Vivo Ph's no Dudosos > 10% Aldo Vivo inicial	12.02.2024		≥ 10,00%	13,38%	S/Y

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

(i) el Saldo de Principal Pendiente de la Serie B sea igual o mayor al 3,907%	12.02.2024		≥ 3,907%	3,907%	S/Y
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,25%	12.02.2024		≤ 1,25%	1,073%	S/Y

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

(i) el Saldo de Principal Pendiente de la Serie C sea igual o mayor al 3,800%	12.02.2024		≥ 3,800%	3,800%	S/Y
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,00%	12.02.2024		≤ 1,00%	1,073%	N

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

(i) el Saldo de Principal Pendiente de la Serie D sea igual o mayor al 1,400% de la suma del	12.02.2024		≥ 1,400%	1,400%	S/Y
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 0,75%	12.02.2024		≤ 0,75%	1,073%	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%	13,66%	N