

Fecha de Pago / Payment Date	Actual / Current	17.10.2023
Fecha de Determinación / Determination Date	Actual / Current	10.10.2023
Fecha de Pago / Payment Date	Precedente / Preceding	17.07.2023
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)		245.281.834,25	% (a / f)	15,83%
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <18 meses)	10.10.2023	667.043,42	% (b / e)	0,278%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses)	10.10.2023	239.643.375,27		
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥ 18 meses)	10.10.2023	4.971.415,56		
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<18 meses)	10.10.2023	240.310.418,69	% (e / f)	15,51%
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		10.10.2023	0,506822%		
h	Retención para Amortización de las Series A1, A2, B, C y D Series A1, A2, B, C & D Amortisation Withholding		10.10.2023	12.562.664,26	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.		10.10.2023	12.562.664,26		
j	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency		10.10.2023	0,00	h - i	

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase A Outstanding Principal Balance Class A	Precedente	17.07.2023	231.004.613,22		
A1	Saldo Principal Pendiente Serie A1 Outstanding Principal Balance Series A1	Precedente	17.07.2023	0,00		
A2	Saldo Principal Pendiente Serie A2 Outstanding Principal Balance Series A2	Precedente	17.07.2023	231.004.613,22		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B	Precedente	17.07.2023	7.310.562,56	% (B / F)	2,891%
C	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C	Precedente	17.07.2023	7.866.883,47	% (C / F)	3,111%
D	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D	Precedente	17.07.2023	6.691.023,70	% (D / F)	2,646%
E	Saldo Principal Pendiente Serie E Outstanding Principal Balance Series E	Precedente	17.07.2023	10.839.516,06		
F	Saldo Principal Pendiente Series A1, A2, B, C y D Outstanding Principal Balance Series A1, A2, B, C and D	Precedente	17.07.2023	252.873.082,95		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Precedente / Preceding	17.07.2023	10.300.000,00		
n	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Precedente / Preceding	17.07.2023	10.300.000,00	(n - m)	0,00
o	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Actual / Current	17.10.2023	10.300.000,00		
p	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Actual / Current	17.10.2023	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

NO PROCEDE

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	10.10.2023	i	> 98% * (B + C + D)	21.431.100,34	N
2.2.2 Serie C / Series C	10.10.2023	j	> 81% * (C + D)	11.791.904,81	N
2.2.3 Serie D / Series D	10.10.2023	i	> 69% * D	4.616.806,35	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)	17.10.2023	(p - o)	= 0,00	0,00	S/Y
(ii)	10.10.2023	% (a / f)	≥ 10,00%	15,83%	S/Y
2.3.1 Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (*)					S/Y
(i)	10.10.2023	% (B / F)	≥ 2,891%	2,891%	S/Y
(ii)	10.10.2023	% (b / e)	≤ 1,50%	0,278%	S/Y
2.3.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (*)					S/Y
(i)	10.10.2023	% (C / F)	≥ 3,111%	3,111%	S/Y
(ii)	10.10.2023	% (b / e)	≤ 1,25%	0,278%	S/Y
2.3.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (*)					S/Y
(i)	10.10.2023	% (D / F)	≥ 2,646%	2,646%	S/Y
(ii)	10.10.2023	% (b / e)	≤ 0,75%	0,278%	S/Y

2.4 Reducción Fondo Reserva Requerido: condiciones ()**

Required Cash Reserve reduction: conditions

NO PROCEDE POR ESTAR EN EL MINIMO

(*) 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
10.10.2023	% (a / f)	< 10,00%	15,83%	N