

Fecha de Pago / Payment Date
Fecha de Determinación / Determination Date
Fecha de Pago / Payment Date
Fecha constitución Fondo / Fund establishment date
Actual / Current **25.09.2023**
Actual / Current **18.09.2023**
Precedente / Preceding **26.06.2023**
24.11.2014
1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation
1.1 Datos: Préstamos Hipotecarios / Data: Mortgage Loans

			Fecha datos <i>Data date</i>	Valor / Importe <i>Value / Amount</i>	Cálculo Ratio <i>Ratio calculation</i>	Ratio (valor) <i>Ratio (value)</i>
a	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>	(b + c + d)	Actual Current	289.301.721,18		
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 Current	18.09.2023 339.312,17	% (b / e)	0,118%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>	(≤ 3 meses) (≤ 3 months)	Actual Current	18.09.2023 288.428.847,75		
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	(≥ 18 meses) (≥ 18 months)	Actual Current	18.09.2023 533.561,26		
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos <i>Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans</i>	(<18 meses) (<18 months)	Actual Current	18.09.2023 288.768.159,92	% (e / g)	41,25%
f	Saldo Vivo acumulado Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Cumulative Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>		Actual Current	18.09.2023 1.048.763,21	% (f / g)	0,15%
g	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>		Precedente Initial	24.11.2014 700.019.357,44		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Serie A <i>Outstanding Principal Balance Series A</i>		Precedente Preceding	26.06.2023 233.927.548,40		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B <i>Outstanding Principal Balance Series B</i>		Precedente Preceding	26.06.2023 63.000.000,00	% (B / C)	21,217%
C	Saldo Principal Pendiente Emisión Bonos <i>Outstanding Principal Balance Bond Issue</i>		Precedente Preceding	26.06.2023 296.927.548,40		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

h	Fondo de Reserva Requerido / <i>Required Cash Reserve</i>		Precedente / <i>Preceding</i>	26.06.2023 30.620.437,05		
i	Fondo de Reserva dotado / <i>Provisioned Cash Reserve</i>		Precedente / <i>Preceding</i>	26.06.2023 29.588.331,35	(i - h)	-1.032.105,70
j	Fondo de Reserva Requerido / <i>Required Cash Reserve</i>		Actual / <i>Current</i>	25.09.2023 30.620.437,05		
k	Fondo de Reserva dotado / <i>Provisioned Cash Reserve</i>		Actual / <i>Current</i>	25.09.2023 28.978.448,66	(k - j)	-1.641.988,39

2 Situación disparadores / Triggers status
2.1 Pago intereses Series B: postergación lugar orden de prelación
Interest payment of Series: place deferred in priority of payments

Fecha datos <i>Data date</i>	Disparador <i>Trigger</i>	Condición <i>Condition</i>	Valor Disparador <i>Trigger value</i>	Actúa S/N <i>Breach Y/N</i>
18.09.2023	% (f / g)	> 4,00%	0,15%	N

2.2 Fondo de Reserva:
Cash Reserve
2.2.1 Condiciones de reducción
Cash Reserve reduction:

25.09.2023	% C- (C-e)	> 10,00%	10,60%	S/Y
------------	------------	----------	--------	-----

2.2.2 Condiciones de no reducción (solo aplica si 2.2.1 es S/Y) (*)
Cash Reserve no reduction ()*

(i) Morosos / Saldo Vivo no dudosos

18.09.2023	% (b / e)	> 1,00%	0,118%	N
------------	-----------	---------	--------	---

(ii) No dotación

25.09.2023	(k - j)	< 0,00	-1.641.988,39	S/Y
------------	---------	--------	---------------	-----

(iii) Transcurridos 3 años

25.09.2023	24.11.2014	años/years < 3,00	8,84	N
------------	------------	-------------------	------	---

(*) 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 <i>Data date</i>	Disparador <i>Trigger</i>	Condición <i>Condition</i>	Valor Disparador <i>Trigger value</i>	Opción ejercitable <i>S/N</i> <i>Exercisable option Y/N</i>
18.09.2023	% (a / g)	< 10,00%	41,33%	N

EUROPEA DE TITULIZACIÓN, S.A., S.G.F.T

C/ Jorge Juan, 68 -MADRID- (SPAIN)

<http://www.edt-sg.com/e/>
info@edt-sg.com