

Fecha de Pago / Payment Date

Fecha de Determinación / Determination Date

Fecha de Pago / Payment Date

Fecha constitución Fondo / Fund establishment date

Actual / Current	24.10.2022
Actual / Current	30.09.2022
Precedente / Preceding	26.09.2022
Precedente / Preceding	08.07.2022

1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation

1.1 Datos: Derechos Credito / Data: Receivables

a	Saldo Vivo Derechos de Credito	(b + c + d)	Actual	30.09.2022	693.602.736,24		
	Outstanding Balance of the Receivables		Current				
b	Saldo Vivo Dchos Credito Morosos (no Dudosos)	(>3 y <6 meses)	Actual	30.09.2022	0,00	% (b / e)	0,000%
	Outstanding Balance Delinquent Receivables (Non-Doubtful)	(>3 and <6 months)	Current				
c	Saldo Vivo Derechos Credito no Morosos (no Dudosos)	(≤ 3 meses)	Actual	30.09.2022	693.602.736,24		
	Outstanding Balance Non-Delinquent Receivables (Non-Doubtful)	(≤3 months)	Current				
e	Saldo Vivo Derechos Credito Dudosos	(≥6 meses)	Actual	30.09.2022	0,00		
	Outstanding Balance Doubtful Receivables	(≥6 months)	Current				
f	Saldo Vivo Derechos Credito no Dudosos	(<6 meses)	Actual	30.09.2022	693.602.736,24		
	Outstanding Balance Non-Doubtful Receivables	(<6 months)	Current				
g	Saldo Vivo Derechos Credito		Initial	08.07.2022	749.999.990,20	% (a / f)	92,48%
	Outstanding Balance Receivables		Initial				
h	Saldo Vivo acumulado Derechos Credito Dudosos	(<6 meses)	Actual	24.10.2022	0,00		
	cumulative Outstanding Balance of Doubtful Receivable	(<6 months)	Current				
i	Fechas de determinación desde Constitución		Actual	30.09.2022	2		
	Determination Date since Incorporation		Current				
j	Saldo Vivo Derechos Credito no Dudosos	(<6 meses)	Precedente	26.09.2022	713.152.208,43		
	Outstanding Balance Non-Doubtful Receivables	(<6 months)	Preceding				
k	Saldo vivo acumulado de Derechos Credito Dudosos	(≥6 meses)	Precedente	26.09.2022	0,00		
	Cumulative Outstanding Balance Doubtful Receivables	(≥6 months)	Preceding				
l	Ratio Bruto de Dudosos		Actual	30.09.2022	0,00%		
	Gross Default Ratio		Current				
m	Ratio Bruto de Dudosos		Precedente	26.09.2022	0,00%		
	Gross Default Ratio		Preceding				
n	Valor de referencia		Actual	30.09.2022	0,700%		
	Reference Value		Current				
o	Saldo Vivo Derechos Credito no Dudosos	(<6 meses)	Precedente	26.09.2022	0,00		
	Outstanding Balance Non-Doubtful Receivables	(<6 months)	Preceding				
p	Fondos Disponibles después de pagar ítems del 1 al 10 del OPP				21.516.018,36		
	Remaining available Funds after payment of items 1st to 10th of the waterfall						
q	Déficit de Amortización				0,00		
	Principal Deficiency Amount						

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Serie A		Precedente	26.09.2022	476.385.719,70	% (A / I)	66,800%
	Outstanding Principal Balance Serie A		Preceding				
B	Saldo Principal Pendiente Serie B		Precedente	26.09.2022	80.823.924,50	% (B / I)	11,333%
	Outstanding Principal Balance Serie B		Preceding				
C	Saldo Principal Pendiente Serie C		Precedente	26.09.2022	47.543.485,00	% (C / I)	6,667%
	Outstanding Principal Balance Serie C		Preceding				
D	Saldo Principal Pendiente Serie D		Precedente	26.09.2022	30.427.830,40	% (D / I)	4,267%
	Outstanding Principal Balance Serie D		Preceding				
E	Saldo Principal Pendiente Serie E		Precedente	26.09.2022	15.213.915,20	% (E / I)	2,133%
	Outstanding Principal Balance Serie E		Preceding				
F	Saldo Principal Pendiente Serie F		Precedente	26.09.2022	11.410.436,40	% (F / I)	1,600%
	Outstanding Principal Balance Serie F		Preceding				
G	Saldo Principal Pendiente Serie G		Precedente	26.09.2022	51.346.963,80	% (G / I)	7,200%
	Outstanding Principal Balance Serie G		Preceding				
H	Saldo Principal Pendiente Serie H		Precedente	26.09.2022	8.482.964,49		
	Outstanding Principal Balance Serie H		Preceding				
I	Saldo Principal Pendiente Coateralizados (A+B+C+D+E+F+G)		Precedente	26.09.2022	713.152.275,00		
	Outstanding Principal Balance of the Collateralised Notes		Preceding				

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve					8.115.152,47		
El menor de / The lower of:							
(i) Fondo de Reserva Inicial / Initial Cash Reserve	Initial/Initial	08.07.2022			8.800.000,00		
(ii) El mayor de / the higher of:	Actual / Currently	24.10.2022			8.115.152,47		
a) 1,17% x (A+B+C+D+E+F+G)					3.200.000,00		
b) Floor: 3,200,000 EUR							
Fondo de Reserva Dotado / Provisioned Cash Reserve					8.115.152,47		

FR dotado?
Cash Reserve fully
provisioned?
SI/YES

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 Pago intereses Series B, C, D, E, F y G: postergación lugar orden de prelación

Interest payment of Series B, C, D, E, F and G: place deferred in priority of payments

2.1.1 Serie B / Series B

30.09.2022 (I - (n+p)) > (C+D+E+F+G) > 155.942.630,80 -1.966.479,60 N

2.1.2 Serie C / Series C

30.09.2022 (I - (n+p)) > (D+E+F+G) > 108.399.145,80 -1.966.479,60 N

2.1.3 Serie D / Series D

30.09.2022 (I - (n+p)) > (E+F+G) > 77.971.315,40 -1.966.479,60 N

2.1.4 Serie E / Series E

30.09.2022 (I - (n+p)) > (F+G) > 62.757.400,20 -1.966.479,60 N

2.1.5 Serie F / Series F

30.09.2022 (I - (n+p)) > G > 51.346.963,80 -1.966.479,60 N

2.1.5 Serie G / Series G

30.09.2022 (I - (n+p)) > 0 > 0,00 -1.966.479,60 N

2.2 Amortización secuencial Series A, B, C, D, E, F y G

Sequential Amortisation of Series A, B, C, D, E, F and G

2.2.1 Condiciones comunes / Common conditions ()**

(i) Ratio Bruto Dudosos > Valor Referencia	30.09.2022	k > m	> 0,70%	0,00%	N
Gross Default Ratio > Reference Value					
(ii) Incremento de Ratio Bruto Dudosos durante 2 Fechas de Pagos seguidas > +0,50%	30.09.2022	(l - m)	> 0,50%	0,00%	N
Increase of Gross Default Ratio during 2 consecutive Payment Dates > +0,50%					
(iii) Déficit de Amortización	24.10.2022	q	> 749.999,99	0,00	N
Principal Deficiency Amount					
(iv) Saldo Vivo de Derechos de Crédito < 10% * Saldo Vivo Inicial		a	> 74.999.999,02	693.602.736,24	N
Outstanding Balance of the Receivables < 10,00% of the Initial Balance of the Receivables					
(v) Ratio de Derechos de Crédito Morosos > 5,00%	30.09.2022	b	> 5,00%	0,00%	N
Delinquency Ratio > 5,00%					

3 Amortización Anticipada opcional / Optional Early Amortization

Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Opción ejercitable S/N Exercitable Option Y/N
30.09.2022	% (a / f)	< 10,00%	92,48%	N

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

C/ Jorge Juan, 68 (2ª) -MADRID- (SPAIN)

<http://www.edt-sg.com/en/>

info@edt-sg.com