

Fecha de Pago / Payment Date

Fecha de Determinación / Determination Date

Fecha de Pago / Payment Date

Fecha constitución Fondo / Fund establishment date

Actual / Current	24.01.2023
Actual / Current	31.12.2022
Precedente / Preceding	28.12.2022
	08.07.2022

1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation

1.1 Datos: Derechos Crédito / Data: Receivables

			Fecha datos Data date	Valor / Importe Value / Amount	Cálculo Ratio Ratio calculation	Ratio (valor) Ratio (value)
a	Saldo Vivo Derechos de Crédito Outstanding Balance of the Receivables	(b + c + d)	Actual 31.12.2022	637.339.771,85		
b	Saldo Vivo Dchos Crédito Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Receivables (Non-Doubtful)	(>3 y <6 meses)	Actual 31.12.2022	1.780.795,96	% (b / e)	0,279%
c	Saldo Vivo Derechos Crédito no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Receivables (Non-Doubtful)	(>3 and <6 months)	Actual 31.12.2022	635.558.975,89		
e	Saldo Vivo Derechos Crédito Dudosos Outstanding Balance Doubtful Receivables	(≤3 meses)	Actual 31.12.2022	0,00		
f	Saldo Vivo Derechos Crédito no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Receivables	(<6 meses)	Actual 31.12.2022	637.339.771,85		
g	Saldo Vivo Derechos Crédito Outstanding Balance Receivables		Initial 08.07.2022	749.999.990,20	% (a / f)	84,98%
h	Saldo Vivo acumulado Derechos Crédito Dudosos cumulative Outstanding Balance of Doubtful Receivable	(<6 meses)	Actual 24.01.2023	0,00		
i	Fechas de determinación desde Constitución Determination Date since Incorporation	(<6 months)	Actual 31.12.2022	5		
j	Saldo Vivo Derechos Crédito no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Receivables	(<6 meses)	Precedente 28.12.2022	655.617.602,71		
k	Saldo vivo acumulado de Derechos Crédito Dudosos Cumulative Outstanding Balance Doubtful Receivables	(≤6 meses)	Precedente 28.12.2022	0,00		
l	Ratio Bruto de Dudosos Gross Default Ratio		Actual 31.12.2022	0,00%		
m	Ratio Bruto de Dudosos Gross Default Ratio		Precedente 28.12.2022	0,00%		
n	Valor de referencia Reference Value		Actual 31.12.2022	1,300%		
o	Saldo Vivo Derechos Crédito no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Receivables	(<6 meses)	Precedente 28.12.2022	0,00		
p	Fondos Disponibles después de pagar ítems del 1 al 10 del OPP Remaining available Funds after payment of items 1st to 10th of the waterfall			20.224.777,06		
q	Déficit de Amortización Principal Deficiency Amount			0,00		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Serie A Outstanding Principal Balance Serie A		Precedente 28.12.2022	437.952.606,90	% (A / I)	66,800%
B	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Serie B		Precedente 28.12.2022	74.303.336,50	% (B / I)	11,333%
C	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Serie C		Precedente 28.12.2022	43.707.845,00	% (C / I)	6,667%
D	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Serie D		Precedente 28.12.2022	27.973.020,80	% (D / I)	4,267%
E	Saldo Principal Pendiente Serie E Outstanding Principal Balance Serie E		Precedente 28.12.2022	13.986.510,40	% (E / I)	2,133%
F	Saldo Principal Pendiente Serie F Outstanding Principal Balance Serie F		Precedente 28.12.2022	10.489.882,80	% (F / I)	1,600%
G	Saldo Principal Pendiente Serie G Outstanding Principal Balance Serie G		Precedente 28.12.2022	47.204.472,60	% (G / I)	7,200%
H	Saldo Principal Pendiente Serie H Outstanding Principal Balance Serie H		Precedente 28.12.2022	3.708.928,86		
I	Saldo Principal Pendiente Coetizarizados (A+B+C+D+E+F+G) Outstanding Principal Balance of the Collateralised Notes		Precedente 28.12.2022	655.617.675,00		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve				7.456.875,66		FR dotado? Cash Reserve fully provisioned?
El menor de / The lower of:						SI/YES
(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	24.01.2023		7.456.875,66		
a) 1,17% x (A+B+C+D+E+F+G)				3.200.000,00		
b) Floor: 3,200,000 EUR				7.456.875,66		
Fondo de Reserva Dotado / Provisioned Cash Reserve						

2 Situación disparadores / Triggers status

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	31.12.2022	(I - (n+p)) > (C+D+E+F+G)	> 143.361.731,60	-1.946.873,91	N
2.1.2 Serie C / Series C	31.12.2022	(I - (n+p)) > (D+E+F+G)	> 99.653.886,60	-1.946.873,91	N
2.1.3 Serie D / Series D	31.12.2022	(I - (n+p)) > (E+F+G)	> 71.680.865,80	-1.946.873,91	N
2.1.4 Serie E / Series E	31.12.2022	(I - (n+p)) > (F+G)	> 57.694.355,40	-1.946.873,91	N
2.1.5 Serie F / Series F	31.12.2022	(I - (n+p)) > G	> 47.204.472,60	-1.946.873,91	N
2.1.5 Serie G / Series G	31.12.2022	(I - (n+p)) > 0	> 0,00	-1.946.873,91	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 (**)					N
(i) Ratio Bruto Dudosos > Valor Referencia Gross Default Ratio > Reference Value	31.12.2022	k > m	> 1,30%	0,00%	N
(ii) Incremento de Ratio Bruto Dudosos durante 2 Fechas de Pagos seguidas > +0,50% Increase of Gross Default Ratio during 2 consecutive Payment Dates > +0,50%	31.12.2022	(l - m)	> 0,50%	0,00%	N
(iii) Déficit de Amortización Principal Deficiency Amount	24.01.2023	q	> 749.999,99	0,00	N
(iv) Saldo Vivo de Derechos de Crédito < 10% * Saldo Vivo Inicial Outstanding Balance of the Receivables < 10,00% of the Initial Balance of the Receivables		a	> 74.999.999,02	637.339.771,85	N
(v) Ratio de Derechos de Crédito Morosos > 5,00% Delinquency Ratio > 5,00%	31.12.2022	b	> 5,00%	0,28%	N

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
31.12.2022	% (a / f)	< 10,00%	84,98%	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