

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

Actual / Current 19.09.2022
Actual / Current 13.09.2022
Precedente / Preceding 20.06.2022
19.02.2007

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)
	(b + c + d)		
a Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans	Actual Current 647.815.014,13		
b Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <12 meses) (>3 and <12 months) Actual Current 1.079.302,91	% (b / e)	0,170%
c Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses) (≤3 months) Actual Current 632.492.863,18		
d Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥12 meses) (≥12 months) Actual Current 14.242.848,04		
e Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<12 meses) (<12 months) Actual Current 633.572.166,09	% (e / g)	25,34%
f Saldo Vivo acumulado Préstamos Hipotecarios Dudosos Cumulative Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	Actual Current 160.933.205,77	% (f / g)	6,44%
g Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans	Initial 19.02.2007 2.500.000.049,34		
h Ingresos Principal Préstamos Hipotecarios en Periodo Determinación Mortgage Loan principal income during Determination Period	Actual Current 13.09.2022 22.656.109,33		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A Saldo Principal Pendiente Clase A Outstanding Principal Balance Class A	Precedente Preceding 20.06.2022 476.241.480,00		
A1 Saldo Principal Pendiente Serie A1 Outstanding Principal Balance Series A1	Precedente Preceding 20.06.2022 0,00		
A2 Saldo Principal Pendiente Serie A2 Outstanding Principal Balance Series A2	Precedente Preceding 20.06.2022 0,00		
A3 Saldo Principal Pendiente Serie A3 Outstanding Principal Balance Series A3	Precedente Preceding 20.06.2022 476.241.480,00		
B Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B	Precedente Preceding 20.06.2022 105.420.408,00	% (B / D)	16,062%
C Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C	Precedente Preceding 20.06.2022 74.672.789,00	% (C / D)	11,377%
D Saldo Principal Pendiente Emisión Bonos Outstanding Principal Balance Bond Issue	Precedente Preceding 20.06.2022 656.334.677,00		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

j Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Precedente / Preceding 20.06.2022 22.500.000,00		
k Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Precedente / Preceding 20.06.2022 22.500.000,00	(k - j)	0,00
l Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Actual / Current 19.09.2022 22.500.000,00		
m Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Actual / Current 19.09.2022 22.500.000,00	(m - l)	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
13.09.2022	(c + h) / A	≤ 1,00	1,376	N
13.09.2022	% (f / g)	> 12,50%	6,44%	N
13.09.2022	% (f / g)	> 10,00%	6,44%	N
19.09.2022	(m - l)	= 0,00	0,00	S/Y
13.09.2022	% (e / g)	≥ 10,00%	25,34%	S/Y
13.09.2022	2.1	= N		S/Y
13.09.2022	% (B / D)	≥ 9,60%	16,062%	S/Y
13.09.2022	% (b / e)	≤ 1,25%	0,170%	S/Y
13.09.2022	% (C / D)	≥ 6,800%	11,377%	S/Y
13.09.2022	% (b / e)	≤ 1,00%	0,170%	S/Y

**2.4 Fondo de Reserva:
Cash Reserve**

NO PROCEDE POR ESTAR EN EL MINIMO

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
13.09.2022	% (a / g)	< 10,00%	25,91%	N