

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

Actual / Current 20.08.2024
Actual / Current 13.08.2024
Precedente / Preceding 20.05.2024
23.07.2007

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)
a	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans	(b + c + d)		Actual Current 848.951.875,78		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <12 meses) (>3 and <12 months)	13.08.2024	Actual Current 6.892.519,04	% (b / e)	0,849%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses) (≤ 3 months)	13.08.2024	Actual Current 805.010.252,41		
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥ 12 meses) (≥ 12 months)	13.08.2024	Actual Current 37.049.104,33		
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<12 meses) (<12 months)	13.08.2024	Actual Current 811.902.771,45	% (e / g)	27,06%
f	Saldo Vivo acumulado Préstamos Hipotecarios Dudosos Cumulative Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans		13.08.2024	Actual Current 436.792.258,19	% (f / g)	14,56%
g	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		23.07.2007	Initial Initial 3.000.000.126,53		
h	Ingresos Principal Préstamos Hipotecarios en Periodo Determinación Mortgage Loan principal income during Determination Period		13.08.2024	Actual Current 29.890.785,49		
i	Retención para Amortización de las Series A, B y C Series A, B & C Amortisation Withholding		13.08.2024	Actual Current 140.208.440,40		
j	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A, B y C Available Funds applied for Amortization of Series A, B & C		13.08.2024	Actual Current 33.119.506,62		
k	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency		13.08.2024	Actual Current 107.088.933,78		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase A Outstanding Principal Balance Class A	Precedente	20.05.2024	707.611.211,85		
A1	Saldo Principal Pendiente Serie A1 Outstanding Principal Balance Series A1	Precedente	20.05.2024	0,00		
A2	Saldo Principal Pendiente Serie A2 Outstanding Principal Balance Series A2	Precedente	20.05.2024	112.627.331,85		
A3	Saldo Principal Pendiente Serie A3 Outstanding Principal Balance Series A3	Precedente	20.05.2024	594.983.880,00		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B	Precedente	20.05.2024	156.000.000,00	% (B / D)	16,385%
C	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C	Precedente	20.05.2024	88.500.000,00	% (C / D)	9,295%
D	Saldo Principal Pendiente Emisión Bonos Outstanding Principal Balance Bond Issue	Precedente	20.05.2024	952.111.211,85		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

l	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Precedente / Preceding	20.05.2024	39.000.000,00		
m	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Precedente / Preceding	20.05.2024	0,00	(m - l)	-39.000.000,00
n	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Actual / Current	20.08.2024	39.000.000,00		
ñ	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Actual / Current	20.08.2024	0,00	(ñ-n)	-39.000.000,00

2 Situación disparadores / Triggers status
2.1 Amortización a prorrata Clase A / Pro rrata amortisation Class A

Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Actúa S/N Breach Y/N
--------------------------	-----------------------	------------------------	-----------------------------------	-------------------------

13.08.2024	(c + h) / A	≤ 1,05	1,180	N
2.2 Pago Intereses Series B y C: postergación lugar orden de prelación Interest payment of Series B & C: place deferred in priority of payments				
13.08.2024	% (f / g)	> 12,50%	14,56%	S/Y
13.08.2024	% (f / g)	> 10,00%	14,56%	S/Y
2.2.1 Serie B / Series B				
2.2.2 Serie C / Series C				
2.3 Amortización a Prorrata Series B/C Pro Rata Amortisation of Series B/C				
2.3.0 Condiciones comunes / Common conditions (*)				
13.08.2024	2.1	= N		N
20.08.2024	(ñ-n)	= 0,00	-39.000.000,00	S/Y
13.08.2024	% (e / g)	≥ 10,00%	27,06%	N
2.3.1 Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (*)				
13.08.2024	% (B / D)	≥ 10,400%	16,385%	S/Y
13.08.2024	% (b / e)	≤ 1,25%	0,849%	S/Y
2.3.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (*)				
13.08.2024	% (C / D)	≥ 5,900%	9,295%	S/Y
13.08.2024	% (b / e)	≤ 1,00%	0,849%	S/Y
2.4 Fondo de Reserva: Cash Reserve				
2.4.1 Condiciones de reducción Conditions of reduction				
20.08.2024	% (n/(D - j))	> 2,60%	4,24%	S/Y
2.4.2 Condiciones de no reducción (solo aplica si 2.4.1 es S/Y) (**) Conditions of no reduction (**)				
13.08.2024	% (b / e)	> 1,00%	0,849%	N
20.08.2024	(ñ-n)	< 0,00	-39.000.000,00	S/Y
20.08.2024	23.07.2007	años/years < 3,00	17,09	N

(*) 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
13.08.2024	% (a / g)	< 10,00%	28,30%	N

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

Jorge Juan 68, 28009 - Madrid

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