

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

Actual / Current
 Actual / Current
 Precedente / Preceding
 22.02.2024
 16.02.2024
 22.11.2023
 26.01.2007

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	493.155.807,87		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <18 meses) (~3 and <18 months)	Actual Current	16.02.2024 6.056.190,97	% (b / e)	1,305%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Delinq)	(≤ 3 meses) (≤3 months)	Actual Current	16.02.2024 458.084.740,78		
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥ 18 meses) (≥18 months)	Actual Current	16.02.2024 29.014.876,12		
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<18 meses) (<18 months)	Actual Current	16.02.2024 464.140.931,75	% (e / g)	17,85%
f	Saldo Vivo acumulado Préstamos Hipotecarios Dudosos Cumulative Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans		Actual Current	16.02.2024 306.601.426,25		11,79%
g	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		Initial Initial	26.01.2007 2.600.172.859,42		
h	Margen medio ponderado de Préstamos Hipotecarios Weighted average margin of Mortgage Credits		Actual Current	14.02.2024 0,868%		
i	Ingresos principal Préstamos Hipotecarios en Periodo de Determinación Mortgage Loan principal income during Determination Period		Actual Current	16.02.2024 18.268.433,84		
j	Saldo Cuenta de Amortización Balance Amortization Account		Actual Current	16.02.2024 0,00		
k	Retención para Amortización de las Series A, B, C Series A, B, C		Actual Current	16.02.2024 17.375.168,25		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase A Outstanding Principal Balance Class A	Precedente Preceding	22.11.2023	338.516.100,00		
A1	Saldo Principal Pendiente Serie A1 Outstanding Principal Balance Series A1	Precedente Preceding	22.11.2023	0,00		
A2	Saldo Principal Pendiente Serie A2 Outstanding Principal Balance Series A2	Precedente Preceding	22.11.2023	0,00		
A3	Saldo Principal Pendiente Serie A3 Outstanding Principal Balance Series A3	Precedente Preceding	22.11.2023	338.516.100,00		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B	Precedente Preceding	22.11.2023	65.000.000,00	% (B / F)	13,499%
C	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C	Precedente Preceding	22.11.2023	52.000.000,00	% (C / F)	10,799%
D	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D	Precedente Preceding	22.11.2023	26.000.000,00	% (D / F)	5,400%
E	Saldo Principal Pendiente Serie E Outstanding Principal Balance Series E	Precedente Preceding	22.11.2023	31.000.000,00		
F	Saldo Principal Pendiente Series A1, A2, A3, B, C y D Outstanding Principal Balance Series A1, A2, A3, B, C and D	Precedente Preceding	22.11.2023	481.516.100,00		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Precedente / Preceding	22.11.2023	31.000.000,00		
n	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Precedente / Preceding	22.11.2023	7.340.625,05	(n - m)	-23.659.374,95
o	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Actual / Currently	22.02.2024	31.000.000,00		
p	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Actual / Currently	22.02.2024	9.131.302,48	(p - o)	-21.868.697,52

2 Situación disparadores / Triggers status

Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Actúa S/N Breach Y/N
16.02.2024	(c + i + j) / A	≤ 1,00	1,41	N

2.1 Amortización a Prorrata Clase A / Pro Rata Amortisation Class A

2.2 Pago intereses Series B, C y D: postergación lugar orden de prelación

Interest payment of Series B, C & D: place deferred in priority of payments

2.2.1 Serie B / Series B

(i)	Saldo Vivo acumulado Prést Dudosos / Saldo Vivo de los Prest constituc Fondo >10,90%	16.02.2024	% (f / g)	> 10,90%	11,79%	S/Y
(ii)	No completa amortización bonos Serie A			A> 0	338.516.100,00	S/Y

2.2.2 Serie C / Series C

(i)	Saldo Vivo acumulado Prést Dudosos / Saldo Vivo de los Prest constituc Fondo >7,40%	16.02.2024	% (f / g)	> 7,40%	11,79%	S/Y
(ii)	No completa amortización bonos Serie A + B			A+B> 0	403.516.100,00	S/Y

2.2.3 Serie D / Series D

(i)	Saldo Vivo acumulado Prést Dudosos / Saldo Vivo de los Prest constituc Fondo >5,70%	16.02.2024	% (f / g)	> 5,70%	11,79%	S/Y
(ii)	No completa amortización bonos Serie A + B + C			A+B+C> 0	455.516.100,00	S/Y

2.3 Amortización a Prorrata Series B, C y D

Pro Rata Amortisation of Series B, C & D

2.3.0 Condiciones comunes / Common conditions (*)

(i)	Fondo Reserva dotado en su totalidad FP precedente y FP correspondiente	22.11.2023	(n - m)	= 0,00	-23.659.374,95	N
(ii)	Fecha Determinac precedente Saldo Vivo Prestamos >=10% Saldo Vivo inial a la constituc	16.02.2024	% (a / g)	≥ 10,00%	18,97%	S/Y

2.3.1 Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (*)

(i)	Saldo Principal Pendiente de la Serie B >=5,00% del Saldo de Ppal Pdtte Emision Bonos	16.02.2024	% (B / F)	≥ 5,000%	13,499%	S/Y
(ii)	Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,25% del Saldo Vivo Prestamos no Dudosos	16.02.2024	% (b / e)	≤ 1,25%	1,305%	N

2.3.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (*)

(i)	Saldo de Principal Pendiente de la Serie C >=4,00% del Saldo Ppa Pdtte Emision Bonos	16.02.2024	% (C / F)	≥ 4,000%	10,799%	S/Y
(ii)	Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,00% del Saldo Vivo Prestamos no Dudosos	16.02.2024	% (b / e)	≤ 1,00%	1,305%	N

2.3.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (*)

(i)	Saldo de Principal Pendiente de la Serie D >=2,00% del Saldo Ppa Pdtte Emision Bonos	16.02.2024	% (D / F)	≥ 2,000%	5,400%	S/Y
(ii)	Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 0,75% del Saldo Vivo Prestamos no Dudosos	16.02.2024	% (b / e)	≤ 0,75%	1,305%	N

2.4 Fondo de Reserva:

Cash Reserve

2.4.1 Condiciones de reduccion

Cash Reserve reduction:

2.4.2 Condiciones de no reduccion (solo aplica si 2.4.1 es S/Y) (**)

Conditions Cash Reserve reduction (only applicable if 2.4.1 is S/Y)(**)

(i)	Salvo Vivo Prestamos Morosos > 1% Saldo Vivo Prestamos no Dudosos	16.02.2024	% (b / e)	≥ 1,00%	1,305%	S/Y
(ii)	No se pudiera dotar el Fondo Reserva Requerido	22.02.2024	(p - o)	< 0,00	-21.868.697,52	S/Y
(iii)	Margen medio ponderado por el principal pendiente de vencimiento ≤ 0,60%	16.02.2024	h	≤ 0,600%	0,868%	N
(iv)	Que no hubieran transcurrido 3 años desde la fecha de constitucion del Fondo	22.02.2024	26.01.2007	años/years < 3,00	17,08	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
16.02.2024	% (a / g)	< 10,00%	18,97%	N