

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

Actual / Current 29.01.2024
Actual / Current 23.01.2024
Precedente / Preceding 27.10.2023
20.07.2007

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 469.345.350,19		
b Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(≥3 y <18 meses) Actual 6.365.214,09	% (b / e)	1,438%
c Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(≤3 meses) Actual 436.349.996,99		
d Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥18 meses) Actual 26.630.139,11		
e Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<18 meses) Actual 442.715.211,08	% (e / g)	22,14%
f Saldo Vivo acumulado Préstamos Hipotecarios Dudosos Cumulative Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	Actual 267.181.788,12	% (f / g)	13,36%
g Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans	Initial 2.000.022.095,64		
h Margen medio ponderado de Préstamos Hipotecarios Weighted average margin of Mortgage Credits	Actual 0,831119%		
i Ingresos principal Préstamos Hipotecarios en Periodo de Determinación Mortgage Loan principal income during Determination Period	Actual 15.423.558,33		
j Saldo Cuenta de Amortización Balance Amortization Account	Actual 0,00	Cancelada / Cancelled	
k Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A1, A2, A3, B, C, D Available Funds applied for Amortization of Series A1, A2, A3, B, C, D	Actual 16.379.652,92		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A Saldo Principal Pendiente Clase A Outstanding Principal Balance Class A	Precedente 27.10.2023 352.094.864,00		
A1 Saldo Principal Pendiente Serie A1 Outstanding Principal Balance Series A1	Precedente 27.10.2023 0,00		
A2 Saldo Principal Pendiente Serie A2 Outstanding Principal Balance Series A2	Precedente 27.10.2023 0,00		
A3 Saldo Principal Pendiente Serie A3 Outstanding Principal Balance Series A3	Precedente 27.10.2023 352.094.864,00		
B Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B	Precedente 27.10.2023 63.000.000,00	% (B / F)	13,723%
C Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C	Precedente 27.10.2023 24.000.000,00	% (C / F)	5,228%
D Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D	Precedente 27.10.2023 20.000.000,00	% (D / F)	4,356%
E Saldo Principal Pendiente Serie E Outstanding Principal Balance Series E	Precedente 27.10.2023 22.900.000,00		
F Saldo Principal Pendiente Series A1, A2, A3, B, C y D Outstanding Principal Balance Series A1, A2, A3, B, C and D	Precedente 27.10.2023 459.094.864,00		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Precedente / Preceding 27.10.2023 22.900.000,00		
n Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Precedente / Preceding 27.10.2023 0,00	(n - m)	-22.900.000,00
o Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Actual / Currently 29.01.2024 22.900.000,00		
p Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Actual / Currently 29.01.2024 0,00	(p - o)	-22.900.000,00

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 Amortización a Prorrata Clase A / Pro Rata Amortisation Class A

23.01.2024 (c + i + j) / A ≤ 1,00 1,28 N

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

23.01.2024 % (f / g) > 10,90% 13,36% S/Y

2.2.2 Serie C / Series C

23.01.2024 % (f / g) > 7,40% 13,36% S/Y

2.2.3 Serie D / Series D

23.01.2024 % (f / g) > 5,62% 13,36% 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 totalmente en Fecha Pago Actual y anterior	29.01.2024 (p - o) y (m - n) = 0,00 -22.900.000,00 N
(ii) Saldo vivo ≥ 10% Saldo Inicial Fondo	23.01.2024 % (a / g) ≥ 10,00% 23,47% S/Y

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

(i) Saldo Serie B ≥ 5,67% de (Saldo Series A1,A2,A3,B,C y D - Cta Amortización)	23.01.2024 % (B / F) ≥ 5,670% 13,723% S/Y
(ii) Saldo vivo Morosos ≤ 1,10% de Saldo vivo no dudosos	23.01.2024 % (b / e) ≤ 1,10% 1,438% N

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

(i) Saldo Serie C ≥ 2,16% de (Saldo Series A1,A2,A3,B,C y D - Cta Amortización)	23.01.2024 % (C / F) ≥ 2,160% 5,228% S/Y
(ii) Saldo vivo Morosos ≤ 0,85% de Saldo vivo no dudosos	23.01.2024 % (b / e) ≤ 0,85% 1,438% N

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

(i) Saldo Serie D ≥ 1,80% de (Saldo Series A1,A2,A3,B,C y D - Cta Amortización)	23.01.2024 % (D / F) ≥ 1,800% 4,356% S/Y
(ii) Saldo vivo Morosos ≤ 0,6% de Saldo vivo no dudosos	23.01.2024 % (b / e) ≤ 0,60% 1,438% N

2.4 Fondo de Reserva;

Cash Reserve:

2.4.1 Condiciones de reducción:

29.01.2024 % o(F-(F-e)) > 2,29% 5,173% S/Y
--

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

Conditions Cash Reserve reduction (only applicable if 2.4.1 is S/Y)(**)					
(i) Saldo Vivo Morosos ≥ 1% Saldo Vivo no Dudosos	23.01.2024	% (b / e)	≥ 1,00%	1,438%	S/Y
(ii) No se pudiera dotar el Fondo Reserva Requerido	27.10.2023	(n - m)	< 0,00	-22.900.000,00	S/Y
(iii) Margen medio Indices Ref por Ppal Pte Vencer ≤ 0,66%	23.01.2024	h	≤ 0,660%	0,831%	N
(iv) No hayan pasado 3 años desde Constitución Fondo	29.01.2024	20.07.2007	años/years < 3,00	16,54	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
--------------------------	-----------------------	------------------------	-----------------------------------	--

23.01.2024 % (a / g) < 10,00% 23,47% N

4 Amortización Acelerada Serie E / Accelerated Amortization Series E

Opción Ejercida S/N / Option exercised Y/N

N