

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

Actual / Current 17.07.2023
 Actual / Current 10.07.2023
 Precedente / Preceding 17.04.2023
 25.11.2005

1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation				Fecha datos Data date	Valor / Importe Value / Amount	Cálculo Ratio Ratio calculation	Ratio (valor) Ratio (value)	
1.1 Datos: Préstamos / Data: Loans								
a	Saldo Vivo Certificados de Transmisión de Hipoteca Outstanding Balance Mortgage Transfer Certificates	Actual Current	10.07.2023		102.719.407,99	% (a / f)	10,27%	
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (deuda > 90 días y < 18 meses) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (> 90 days & < 18 months)	(>3 y <18 meses) Actual Current	10.07.2023		234.125,13	% (b / k)	0,230%	
c	Saldo Vivo Préstamos no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Loans (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses) Actual Current	10.07.2023		101.373.171,43			
d	Saldo Vivo Participaciones Hipotecarias dudosas Outstanding Balance doubtful Mortgage Certificates	(≥18 meses) Actual Current	10.07.2023		877.986,30			
e	Saldo Acumulado de Préstamos Fallidos	(≥18 meses) Actual Current	10.07.2023		111.580.732,76	% (e / f)	11,16%	
f	Saldo Vivo Préstamos Outstanding Balance Loans	Inicial Initial	25.11.2005		1.000.000.168,62	% (k / f)	10,16%	
g	Retención para Amortización de las Series A2a, A2b, B, C y D Series A2a, A2b, B, C & D Amortisation Withholding	Actual Current	10.07.2023		4.388.087,02	F - k		
h	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A2a, A2b, B, C y D Available Funds applied for Amortization of Series A2a, A2b, B, C & D.	Actual Current	10.07.2023		4.388.087,02			
i	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency	Actual Current	10.07.2023		0,00	q - h		
j	Saldo Vivo en Ejecución Hipotecaria Outstanding Balance under foreclosure	Actual Current	10.07.2023		234.125,13			
k	Saldo Vivo Cartera Hipotecaria Outstanding Balance Loans	Actual Current	10.07.2023		101.607.296,56			
1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue								
A	Saldo Principal Pendiente Clase A2a Outstanding Principal Balance Class A2a	Precedente Preceding	17.04.2023		34.809.900,00			
B	Saldo Principal Pendiente Serie A2b Outstanding Principal Balance Series A2b	Precedente Preceding	17.04.2023		16.444.196,76	% (B / F)	15,514%	
C	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B	Precedente Preceding	17.04.2023		18.876.305,80	% (C / F)	17,809%	
D	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C	Precedente Preceding	17.04.2023		15.701.654,37	% (D / F)	14,814%	
E	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D	Precedente Preceding	17.04.2023		20.163.326,65	% (E / F)	19,023%	
F	Saldo Principal Pendiente Series A2a, A2b, B, C y D Outstanding Principal Balance Series A2a, A2b, B, C and D	Precedente Preceding	17.04.2023		105.995.383,58			
1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve								
m	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Precedente / Preceding	17.04.2023		8.000.000,00			
n	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Precedente / Preceding	17.04.2023		8.000.000,00	(n - m)	0,00	
o	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Actual / Current	17.07.2023		8.000.000,00			
p	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Actual / Current	17.07.2023		8.000.000,00	(p - o)	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
2.1 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								
2.1.1 Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (*)								
(i)	Saldo Acumulado de Préstamos Fallidos / Saldo Vivo Préstamos Inicial		10.07.2023	% (e/f)	≥ 13,82%	11,16%	N	
(ii)	Suma Saldo Principal Pendiente Clase Serie A2a y A2b		10.07.2023	A+B	> 0,00	51.254.096,76	N	
2.1.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (*)								
(i)	Saldo Acumulado de Préstamos Fallidos / Saldo Vivo Préstamos Inicial		10.07.2023	% (e/f)	≥ 10,39%	11,16%	S/Y	
(ii)	Suma Saldo Principal Pendiente Clase Serie A2a, A2b y B		10.07.2023	A+B+C	> 0,00	70.130.402,56	S/Y	
2.1.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (*)								
(i)	Saldo Acumulado de Préstamos Fallidos / Saldo Vivo Préstamos Inicial		10.07.2023	% (e/f)	≥ 7,00%	11,16%	S/Y	
(ii)	Suma Saldo Principal Pendiente Clase Serie A2a, A2b, B y C		10.07.2023	A+B+C+D	> 0,00	85.832.056,93	S/Y	
2.2 Amortización a Prorrata Series B, C y D Pro Rata Amortisation of Series B, C y D								
2.2.1 Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (*)								
(i)	Ratio de morosidad.		10.07.2023	% (b / k)	< 1,500%	0,230%	S/Y	
(ii)	Saldo Bono Serie B / Saldo Principal Pendiente Series A2a, A2b, B, C y D		10.07.2023	% (C / F)	≥ 4,40%	17,81%	S/Y	
(iii)	FR Requerido FP Precedente es igual al FR Dotado.		10.07.2023	(n - m)	= 0,00	0,00	S/Y	
(iv)	Saldo Vivo CTH / Saldo Vivo Préstamos inicial		10.07.2023	% (a / f)	> 10,00%	10,27%	S/Y	
2.2.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (*)								
(i)	Ratio de morosidad.		10.07.2023	% (b / k)	< 1,250%	0,230%	S/Y	
(ii)	Saldo Bono Serie C / Saldo Principal Pendiente Series A2a, A2b, B, C y D		10.07.2023	% (D / F)	≥ 3,66%	14,81%	S/Y	
(iii)	FR Requerido FP Precedente es igual al FR Dotado.		10.07.2023	(n - m)	= 0,00	0,00	S/Y	
(iv)	Saldo Vivo CTH / Saldo Vivo Préstamos inicial		10.07.2023	% (a / f)	> 10,00%	10,27%	S/Y	
2.2.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (*)								
(i)	Ratio de morosidad.		10.07.2023	% (b / k)	< 1,000%	0,230%	S/Y	
(ii)	Saldo Bono Serie D / Saldo Principal Pendiente Series A2a, A2b, B, C y D		10.07.2023	% (E / F)	≥ 4,70%	19,02%	S/Y	
(iii)	FR Requerido FP Precedente es igual al FR Dotado.		10.07.2023	(n - m)	= 0,00	0,00	S/Y	
(iv)	Saldo Vivo CTH / Saldo Vivo Préstamos inicial		10.07.2023	% (a / f)	> 10,00%	10,27%	S/Y	
2.3 Reducción Fondo Reserva Requerido: condiciones de no reducción (**):				NO PROCEDE SE ENCUENTRA EN EL MINIMO				
				Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Opción ejercitable S/N Exercisable option Y/N
3 Amortización Anticipada opcional / Optional Early Amortization				10.07.2023	% (a / f)	< 10,00%	10,27%	N