

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
25.11.2005

1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation

1.1 Datos: Préstamos / Data: Loans

a	Saldo Vivo Certificados de Transmisión de Hipoteca <i>Outstanding Balance Mortgage Transfer Certificates</i>		Actual Current	06.10.2023	98.916.089,33	% (a / f)	9,89%
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (deuda > 90 días y < 18 meses) <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (> 90 days & < 18 months)</i>	(>3 y <18 meses) (>3 and <18 months)	Actual Current	06.10.2023	427.369,05	% (b / k)	0,437%
c	Saldo Vivo Préstamos no Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Non-Delinquent Loans (Non-Doubtful)</i>	(≤ 3 meses) (≤3 months)	Actual Current	06.10.2023	97.271.852,61		
d	Saldo Vivo Participaciones Hipotecarias dudosas <i>Outstanding Balance doubtful Mortgage Certificates</i>	(≥18 meses) (≥18 months)	Actual Current	06.10.2023	863.799,40		
e	Saldo Acumulado de Préstamos Fallidos	(≥18 meses)	Actual Current	06.10.2023	111.580.732,44	% (e / f)	11,16%
f	Saldo Vivo Préstamos <i>Outstanding Balance Loans</i>		Initial	25.11.2005	1.000.000.168,62	% (k / f)	9,77%
g	Retención para Amortización de las Series A2a, A2b, B, C y D <i>Series A2a, A2b, B, C & D Amortisation Withholding</i>		Actual Current	06.10.2023	3.908.139,24	F - k	
h	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A2a, A2b, B, C y D <i>Available Funds applied for Amortization of Series A2a, A2b, B, C & D.</i>		Actual Current	06.10.2023	3.908.139,24		
i	Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i>		Actual Current	06.10.2023	0,00	g - h	
j	Saldo Vivo en Ejecución Hipotecaria <i>Outstanding balance under foreclosure</i>		Actual Current	06.10.2023	353.068,27		
k	Saldo Vivo Cartera Hipotecaria <i>Outstanding Balance Loans</i>		Actual Current	06.10.2023	97.699.221,66		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A Saldo Principal Pendiente Clase A2a Outstanding Principal Balance Class A2a	Precedente Preceding	17.07.2023	33.368.850,00		
B Saldo Principal Pendiente Serie A2b Outstanding Principal Balance Series A2b	Precedente Preceding	17.07.2023	15.763.444,74	% (B / F)	15,514%
C Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B	Precedente Preceding	17.07.2023	18.094.850,40	% (C / F)	17,809%
D Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C	Precedente Preceding	17.07.2023	15.051.625,56	% (D / F)	14,814%
E Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D	Precedente Preceding	17.07.2023	19.328.590,20	% (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	17.07.2023	101.607.360,90		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Precedente / Preceding	17.07.2023	8.000.000,00		
n Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Precedente / Preceding	17.07.2023	8.000.000,00	(n - m)	0,00
o Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Actual / Current	16.10.2023	8.000.000,00		
p Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Actual / Current	16.10.2023	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 (*)					N
(i) Saldo Acumulado de Préstamos Fallidos / Saldo Vivo Préstamos Inicial	06.10.2023	% (e/f)	≥ 13,82%	11,16%	N
(ii) Suma Saldo Principal Pendiente Clase Serie A2a y A2b	06.10.2023	A+B	> 0,00	49.132.294,74	S/Y
2.1.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (*)					S/Y
(i) Saldo Acumulado de Préstamos Fallidos / Saldo Vivo Préstamos Inicial	06.10.2023	% (e/f)	≥ 10,39%	11,16%	S/Y
(ii) Suma Saldo Principal Pendiente Clase Serie A2a, A2b y B	06.10.2023	A+B+C	> 0,00	67.227.145,14	S/Y
2.1.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (*)					S/Y
(i) Saldo Acumulado de Préstamos Fallidos / Saldo Vivo Préstamos Inicial	06.10.2023	% (e/f)	≥ 7,00%	11,16%	S/Y
(ii) Suma Saldo Principal Pendiente Clase Serie A2a, A2b, B y C	06.10.2023	A+B+C+D	> 0,00	82.278.770,70	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 (*)					N
(i) Ratio de morosidad.	06.10.2023	% (b / k)	< 1,500%	0,437%	S/Y
(ii) Saldo Bono Serie B / Saldo Principal Pendiente Series A2a, A2b, B, C y D	06.10.2023	% (C / F)	≥ 4,40%	17,81%	S/Y
(iii) FR Requerido FP Precedente es igual al FR Dotado.	06.10.2023	(n - m)	= 0,00	0,00	S/Y
(iv) Saldo Vivo CTH / Saldo Vivo Préstamos inicial	06.10.2023	% (a / f)	> 10,00%	9,89%	N
2.2.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (*)					N
(i) Ratio de morosidad.	06.10.2023	% (b / k)	< 1,250%	0,437%	S/Y
(ii) Saldo Bono Serie C / Saldo Principal Pendiente Series A2a, A2b, B, C y D	06.10.2023	% (D / F)	≥ 3,66%	14,81%	S/Y
(iii) FR Requerido FP Precedente es igual al FR Dotado.	06.10.2023	(n - m)	= 0,00	0,00	S/Y
(iv) Saldo Vivo CTH / Saldo Vivo Préstamos inicial	06.10.2023	% (a / f)	> 10,00%	9,89%	N
2.2.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (*)					N
(i) Ratio de morosidad.	06.10.2023	% (b / k)	< 1,000%	0,437%	S/Y
(ii) Saldo Bono Serie D / Saldo Principal Pendiente Series A2a, A2b, B, C y D	06.10.2023	% (E / F)	≥ 4,70%	19,02%	S/Y
(iii) FR Requerido FP Precedente es igual al FR Dotado.	06.10.2023	(n - m)	= 0,00	0,00	S/Y
(iv) Saldo Vivo CTH / Saldo Vivo Préstamos inicial	06.10.2023	% (a / f)	> 10,00%	9,89%	N

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

06.10.2023	% (a / f)	< 10,00%	9,89%	S/Y
------------	-----------	----------	-------	-----