

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		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	08.07.2024	87.192.650,39	% (a / f)	8,72%	
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 (>3 and <18 months) Current	08.07.2024	337.285,20	% (b / k)	0,390%	
c	Saldo Vivo Préstamos no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Loans (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses) Actual (≤3 months) Current	08.07.2024	86.054.013,63			
d	Saldo Vivo Participaciones Hipotecarias dudosas Outstanding Balance doubtful Mortgage Certificates	(≥18 meses) Actual (≥18 months) Current	08.07.2024	464.066,36			
e	Saldo Acumulado de Préstamos Fallidos (≥18 meses)	Actual Current	08.07.2024	111.685.443,90	% (e / f)	11,17%	
f	Saldo Vivo Préstamos Outstanding Balance Loans	Inicial Initial	25.11.2005	1.000.000.168,62	% (k / f)	8,64%	
g	Retención para Amortización de las Series A2a, A2b, B, C y D Series A2a, A2b, B, C & D Amortisation Withholding	Actual Current	08.07.2024	3.423.536,85	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	08.07.2024	3.423.536,85			
i	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency	Actual Current	08.07.2024	0,00	q - h		
j	Saldo Vivo en Ejecución Hipotecaria Outstanding balance under foreclosure	Actual Current	08.07.2024	337.285,20			
k	Saldo Vivo Cartera Hipotecaria Outstanding Balance Loans	Actual Current	08.07.2024	86.391.298,83			
1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue							
A	Saldo Principal Pendiente Clase A2a Outstanding Principal Balance Class A2a	Precedente Preceding	15.04.2024	25.359.800,00			
B	Saldo Principal Pendiente Serie A2b Outstanding Principal Balance Series A2b	Precedente Preceding	15.04.2024	11.979.969,52	% (B / F)	13,339%	
C	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B	Precedente Preceding	15.04.2024	18.094.850,40	% (C / F)	20,147%	
D	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C	Precedente Preceding	15.04.2024	15.051.625,56	% (D / F)	16,759%	
E	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D	Precedente Preceding	15.04.2024	19.328.590,20	% (E / F)	21,520%	
F	Saldo Principal Pendiente Series A2a, A2b, B, C y D Outstanding Principal Balance Series A2a, A2b, B, C and D	Precedente Preceding	15.04.2024	89.814.835,68			
1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve							
m	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Precedente / Preceding	15.04.2024	8.000.000,00			
n	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Precedente / Preceding	15.04.2024	8.000.000,00	(n - m)	0,00	
o	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Actual / Current	15.07.2024	8.000.000,00			
p	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Actual / Current	15.07.2024	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	08.07.2024	% (e/f)	≥ 13,82%	11,17%	N	
(ii)	Suma Saldo Principal Pendiente Clase Serie A2a y A2b	08.07.2024	A+B	> 0,00	37.339.769,52	S/Y	
2.1.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (*)							
(i)	Saldo Acumulado de Préstamos Fallidos / Saldo Vivo Préstamos Inicial	08.07.2024	% (e/f)	≥ 10,39%	11,17%	S/Y	
(ii)	Suma Saldo Principal Pendiente Clase Serie A2a, A2b y B	08.07.2024	A+B+C	> 0,00	55.434.619,92	S/Y	
2.1.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (*)							
(i)	Saldo Acumulado de Préstamos Fallidos / Saldo Vivo Préstamos Inicial	08.07.2024	% (e/f)	≥ 7,00%	11,17%	S/Y	
(ii)	Suma Saldo Principal Pendiente Clase Serie A2a, A2b, B y C	08.07.2024	A+B+C+D	> 0,00	70.486.245,48	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 conditons (*)							
(i)	Ratio de morosidad.	08.07.2024	% (b / k)	< 1,500%	0,390%	S/Y	
(ii)	Saldo Bono Serie B / Saldo Principal Pendiente Series A2a, A2b, B, C y D	08.07.2024	% (C / F)	≥ 4,40%	20,15%	S/Y	
(iii)	FR Requerido FP Precedente es igual al FR Dotado.	08.07.2024	(n - m)	= 0,00	0,00	S/Y	
(iv)	Saldo Vivo CTH / Saldo Vivo Préstamos inicial	08.07.2024	% (a / f)	> 10,00%	8,72%	N	
2.2.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditons (*)							
(i)	Ratio de morosidad.	08.07.2024	% (b / k)	< 1,250%	0,390%	S/Y	
(ii)	Saldo Bono Serie C / Saldo Principal Pendiente Series A2a, A2b, B, C y D	08.07.2024	% (D / F)	≥ 3,66%	16,76%	S/Y	
(iii)	FR Requerido FP Precedente es igual al FR Dotado.	08.07.2024	(n - m)	= 0,00	0,00	S/Y	
(iv)	Saldo Vivo CTH / Saldo Vivo Préstamos inicial	08.07.2024	% (a / f)	> 10,00%	8,72%	N	
2.2.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditons (*)							
(i)	Ratio de morosidad.	08.07.2024	% (b / k)	< 1,000%	0,390%	S/Y	
(ii)	Saldo Bono Serie D / Saldo Principal Pendiente Series A2a, A2b, B, C y D	08.07.2024	% (E / F)	≥ 4,70%	21,52%	S/Y	
(iii)	FR Requerido FP Precedente es igual al FR Dotado.	08.07.2024	(n - m)	= 0,00	0,00	S/Y	
(iv)	Saldo Vivo CTH / Saldo Vivo Préstamos inicial	08.07.2024	% (a / f)	> 10,00%	8,72%	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		08.07.2024	% (a / f)	< 10,00%	8,72%	S/Y	