

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
05.07.2006

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 Hipotecarios / Data: Mortgage Loans						
a	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans	Actual Current	165.329.271,76	(b + c + d)		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no fallidos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <18 meses) Actual (>3 and <18 months) Current	17.01.2023 957.180,75	% (b / e)	0,588%	
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no fallidos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses) Actual (≤ 3 months) Current	17.01.2023 161.773.198,44			
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios fallidos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥18 meses) Actual (≥18 months) Current	17.01.2023 2.598.892,57			
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no fallidos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<18 meses) Actual (<18 months) Current	17.01.2023 162.730.379,19	% (e / f)	10,85%	
f	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans	Initial 05.07.2006	1.500.001.310,05			
g	Saldo Vivo acumulado Préstamos fallidos Cumulative Outstanding Balance Doubtful Loans	Actual 17.01.2023	280.913.888,66			
h	Remanente de Fondos Disponibles tras obligaciones de pago del 1º al 5º lugar Available Funds remaining after payment obligations listed in 1st to 5th place		7.839.528,02			
i	Cuenta de Amortización Amortisation Account		0,00			
1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue						
A	Saldo Principal Pendiente Clase A2 Outstanding Principal Balance Class A2	Precedente 24.10.2022	72.295.785,08	% (A / F)	40,412%	
B	Saldo Principal Pendiente Clase A3 Outstanding Principal Balance Class A3	Precedente 24.10.2022	0,00	% (B / F)	0,000%	
C	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B	Precedente 24.10.2022	54.800.000,00	% (C / F)	30,632%	
D	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C	Precedente 24.10.2022	51.800.000,00	% (D / F)	28,955%	
E	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D	Precedente 24.10.2022	25.500.000,00	% (E / F)	14,254%	
F	Saldo Principal Pendiente Series A, B y C Outstanding Principal Balance Series A, B and C	Precedente 24.10.2022	178.895.785,08			
G	Saldo Principal Inicial Series A, B, C y D Initial Principal Balance Series A, B, C and D	Initial 05.07.2006	1.525.500.000,00			
H	Saldo Principal Inicial Series A, B y C Initial Principal Balance Series A, B and C	Initial 05.07.2006	1.500.000.000,00			
1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve						
j	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Precedente / Preceding 24.10.2022	25.500.000,00			
k	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Precedente / Preceding 24.10.2022	0,00	(k - j)	-25.500.000,00	
l	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Actual / Current 24.01.2023	25.500.000,00			
m	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Actual / Current 24.01.2023	0,00	(m - l)	-25.500.000,00	
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 Pago intereses Series B, y C: postergación lugar orden de prelación Interest payment of Series B, & C: place deferred in priority of payments						
2.1.1 Serie B / Series B						
(i)	Saldo acumulado Préstamos fallidos ≥ 11% Saldo inicial Préstamos Hipotecarios	17.01.2023	% (g / f)	≥ 11,00%	18,73%	S/Y
(ii)	Principal Series A1,A2,A3 y A4 no amortizadas	24.10.2022	A+B	> 0,00	72.295.785,08	S/Y
2.1.2 Serie C / Series C						
(i)	Saldo acumulado Préstamos fallidos ≥ 7% Saldo inicial Préstamos Hipotecarios	17.01.2023	% (g / f)	≥ 7,00%	18,73%	S/Y
(ii)	Principal Series A1,A2,A3,A4 y B no amortizadas	24.10.2022	A+B+C	> 0,00	127.095.785,08	S/Y
2.2 Amortización a Prorrata Clase A Pro Rata Amortisation Class A						
		24.10.2022	% d / G	> 25,00%	0,17%	N
2.3 Amortización a Prorrata Series B, y C Pro Rata Amortisation of Series B, & C						
N						
2.3.0 Condiciones comunes / Common conditions (*)						
(i)	F. Reserva Requerido en F. Pago actual hubiese sido dotado en su totalidad	24.01.2023	(m - l)	= 0,00	-25.500.000,00	N
(ii)	Saldo vivo Préstamos Hipotecarios ≥ 10% Importe nominal de la emisión de Bonos	17.01.2023	% (a / f)	≥ 10,00%	11,02%	S/Y
(iii)	50% del Saldo Inicial de Titulización de las Series A1, A2, A3, A4, B Y C amortizado	24.10.2022	H- A- B- C- D	≥ 750.000.000,00	1.321.104.214,92	S/Y
2.3.1 Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (*)						
(i)	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no fallidos) <1,5% Saldo Vivo inicial CTH'S	17.01.2023	% (b / f)	< 1,500%	0,064%	S/Y
(ii)	Saldo principal pendiente serie B ≥ 7,30% Saldo Principal Pendiente Series A, B y C	17.01.2023	% (C/(A+B+C+D))	≥ 7,30%	30,632%	S/Y
2.3.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (*)						
(i)	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no fallidos) <1,5% Saldo Vivo inicial CTH'S	17.01.2023	% (b / f)	< 1,000%	0,064%	S/Y
(ii)	Saldo principal pendiente serie C ≥ 6,90% Saldo Principal Pendiente Series A, B y C	17.01.2023	% (D/(A+B+C+D))	≥ 6,90%	28,955%	S/Y
2.4 Fondo de Reserva:						
N						
2.4.1 Reducción Fondo Reserva Requerido: condiciones de no reducción (**)						
N						
(i)	Salvo Vivo Prestamos Morosos > 1% Saldo Vivo Prestamos no fallidos	17.01.2023	% (b / e)	> 1,00%	0,588%	N
(ii)	Fecha Pago precedente, Fondo Reserva no dotado en importe de F.R. Requerido	24.10.2022	(k - j)	< 0,00	-25.500.000,00	S/Y
(iii)	Han transcurrido 3 años desde la Constitución	17.01.2023	05.07.2006	años/years < 3,00	16,55	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						
		17.01.2023	% (e / f)	< 10,00%	10,85%	N