

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

Actual / Current 24.01.2024
Actual / Current 17.01.2024
Precedente / Preceding 24.10.2023
Precedente / Preceding 05.07.2006

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	Actual Current		139.562.018,54	(b + c + d)	
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no fallidos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <18 meses) (>3 and <18 months)	Actual Current	17.01.2024 475.702,72	% (b / e)	0,345%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no fallidos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses) (≤3 months)	Actual Current	17.01.2024 137.475.977,21		
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios fallidos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥18 meses) (≥18 months)	Actual Current	17.01.2024 1.610.338,61		
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no fallidos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<18 meses) (<18 months)	Actual Current	17.01.2024 137.951.679,93	% (e / f)	9,20%
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 Current	17.01.2024	281.013.614,98		
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			7.919.389,81		
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 Preceding	24.10.2023	41.386.202,04	% (A / F)	27,966%
B	Saldo Principal Pendiente Clase A3 Outstanding Principal Balance Class A3	Precedente Preceding	24.10.2023	0,00	% (B / F)	0,000%
C	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B	Precedente Preceding	24.10.2023	54.800.000,00	% (C / F)	37,030%
D	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C	Precedente Preceding	24.10.2023	51.800.000,00	% (D / F)	35,003%
E	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D	Precedente Preceding	24.10.2023	25.500.000,00	% (E / F)	17,231%
F	Saldo Principal Pendiente Series A, B y C Outstanding Principal Balance Series A, B and C	Precedente Preceding	24.10.2023	147.986.202,04		
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	24.10.2023	25.500.000,00		
k	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Precedente / Preceding	24.10.2023	0,00	(k - j)	-25.500.000,00
l	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Actual / Current	24.01.2024	25.500.000,00		
m	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve	Actual / Current	24.01.2024	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	17.01.2024	% (g / f)	≥ 11,00%	18,73%	S/Y
(ii)	Principal Series A1,A2,A3 y A4 no amortizadas	24.10.2023	A+B	> 0,00	41.386.202,04	S/Y

2.1.2 Serie C / Series C

(i)	Saldo acumulado Préstamos fallidos ≥ 7% Saldo inicial Préstamos Hipotecarios	17.01.2024	% (g / f)	≥ 7,00%	18,73%	S/Y
(ii)	Principal Series A1,A2,A3,A4 y B no amortizadas	24.10.2023	A+B+C	> 0,00	96.186.202,04	S/Y

2.2 Amortización a Prorrata Clase A

Pro Rata Amortisation Class A	24.10.2023	% d / G	> 25,00%	0,11%		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	24.01.2024	(m - l)	= 0,00	-25.500.000,00	N
(ii)	Saldo vivo Préstamos Hipotecarios ≥ 10% Importe nominal de la emisión de Bonos	17.01.2024	% (a / f)	≥ 10,00%	9,30%	N
(iii)	50% del Saldo Inicial de Titulización de las Series A1, A2, A3, A4, B y C amortizado	24.10.2023	H- A- B- C- D	≥ 750.000.000,00	1.352.013.797,96	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	17.01.2024	% (b / f)	< 1,500%	0,032%	S/Y
(ii)	Saldo principal pendiente serie B ≥ 7,30% Saldo Principal Pendiente Series A, B y C	17.01.2024	%(C/(A+B+C+D))	≥ 7,30%	37,030%	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	17.01.2024	% (b / f)	< 1,000%	0,032%	S/Y
(ii)	Saldo principal pendiente serie C ≥ 6,90% Saldo Principal Pendiente Series A, B y C	17.01.2024	%(D/(A+B+C+D))	≥ 6,90%	35,003%	S/Y

2.4 Fondo de Reserva:

Cash Reserve						N
--------------	--	--	--	--	--	---

2.4.1 Reducción Fondo Reserva Requerido: condiciones de no reducción (**)

Required Cash Reserve reduction: conditions						N
(i)	Salvo Vivo Prestamos Morosos > 1% Saldo Vivo Prestamos no fallidos	17.01.2024	% (b / e)	> 1,00%	0,345%	N
(ii)	Fecha Pago precedente, Fondo Reserva no dotado en importe de F.R. Requerido	24.10.2023	(k - j)	< 0,00	-25.500.000,00	S/Y
(iii)	Han transcurrido 3 años desde la Constitución	17.01.2024	05.07.2006	años/years < 3,00	17,55	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

Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Opción Ejercitable S/N Exercisable Option Y/N
17.01.2024	% (e / f)	< 10,00%	9,20%	S/Y

EUROPEA DE TITULIZACIÓN, S.A. S.G.F.T

C/ Jorge Juan, 68 -MADRID- (SPAIN)

<http://www.edt-sg.com/es/>

info@edt-sg.com