

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
 09.03.2007

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									
1.1	Datos: Préstamos / Data: Loans								
a	Saldo Vivo Préstamos Outstanding Balance Loans	(b + c + d)	Actual Current			163.191.814,65	% (a / f)	10,20%	
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (deuda > 90 días e < 18 meses) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (> 90 days & < 18 months)	(>3 y <18 meses) (>3 and <18 months)	Actual Current	06.10.2023	607.523,03		% (b / f)	0,038%	
c	Saldo Vivo Préstamos no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Loans (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses) (≤ 3 months)	Actual Current	06.10.2023	160.037.761,28		% (b / (a-d))	0,378%	
d	Saldo Vivo Participaciones Hipotecarias dudosas Outstanding Balance doubtful Mortgage Certificates	(≥18 meses) (≥18 months)	Actual Current	06.10.2023	2.546.530,34				
e	Saldo Acumulado de Fallidos Préstamos Dudosos Cumulative Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥18 meses)	Actual Current	06.10.2023	402.440.773,10		% (e / f)	25,15%	
f	Saldo Vivo Préstamos Outstanding Balance Loans		Initial Initial	09.03.2007	1.600.000.049,35				
g	Retención para Amortización de las Series A1, A2, A3, B, C y D Series A1, A2, A3, B, C & D Amortisation Withholding		Actual Current	06.10.2023	63.467.123,05		E- (a-d)		
h	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A1, A2, A3, B, C y D Available Funds applied for Amortization of Series A1, A2, A3, B, C & D		Actual Current	06.10.2023	5.630.632,80				
i	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency		Actual Current	06.10.2023	57.836.490,25		g - h		
j	Ingresos por reembolso de principal de los Certificados de Transmisión Hipotecaria Principal repayment income amount received from Mortgage Certificate			06.10.2023	4.683.841,33				
1.2	Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue								
A	Saldo Principal Pendiente Clase A2 Outstanding Principal Balance Class A2		Precedente Preceding	17.07.2023	107.312.407,36				
B	Saldo Principal Pendiente Serie A3 Outstanding Principal Balance Series A3		Precedente Preceding	17.07.2023	0,00		% (B / E)	0,000%	
C	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B		Precedente Preceding	17.07.2023	52.800.000,00		% (C / E)	23,560%	
D	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C		Precedente Preceding	17.07.2023	64.000.000,00		% (D / E)	28,557%	
E	Saldo Principal Pendiente Series A2, A3, B y C Outstanding Principal Balance Series A2, A3, B and C		Precedente Preceding	17.07.2023	224.112.407,36				
1.3	Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve								
m	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Precedente / Preceding	17.07.2023	28.000.000,00				
n	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve		Precedente / Preceding	17.07.2023	0,00		(n - m)	-28.000.000,00	
o	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Actual / Current	16.10.2023	28.000.000,00				
p	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve		Actual / Current	16.10.2023	0,00		(p - o)	-28.000.000,00	
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	Amortización a Prorrata Clase A / Pro Rata Amortisation Class A				06.10.2023	%(c+i)/(A+B)	≤ 1,00%	1,53%	N
2.2	Pago intereses Series B y C: postergación lugar orden de prelación Interest payment of Series B & C: place deferred in priority of payments								
2.2.1	Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (*)								S/Y
(i)	Saldo acumulado Préstamos fallidos ≥ 13,20% Saldo inicial Préstamos Hipotecarios			06.10.2023	%(e/f)	≥ 13,20%	25,15%		S/Y
(ii)	Principal Series A1,A2,A3 no amortizadas			17.07.2023	A+B	> 0,00	107.312.407,36		S/Y
2.2.2	Serie C / Series C								S/Y
(i)	Saldo acumulado Préstamos fallidos ≥ 8,90% Saldo inicial Préstamos Hipotecarios			06.10.2023	%(e/f)	≥ 8,90%	25,15%		S/Y
(ii)	Principal Series A1,A2,A3 y B no amortizadas			17.07.2023	A+B+C	> 0,00	160.112.407,36		S/Y
2.3	Amortización a Prorrata Series B y C Pro Rata Amortisation of Series B & C								
2.3.0	Condiciones comunes / Common conditions (*)								N
(i)	F. Reserva Requerido en F.Pago actual hubiese sido dotado en su totalidad			16.10.2023	(p - o)	= 0,00	-28.000.000,00		N
(ii)	Saldo vivo Préstamos Hipotecarios > 10% Importe inicial Cartera Hipotecaria			06.10.2023	%(a / f)	> 10,00%	10,20%		S/Y
(iii)	No se den las condiciones para amortización a prorrata Clase A			06.10.2023	%(c+i)/(A+B)	> 1,00%	1,53%		S/Y
2.3.1	Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (*)								S/Y
(i)	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no fallidos) <1,50% Saldo Vivo Cartera Hipotecaria			06.10.2023	%(b / (a-d))	< 1,500%	0,378%		S/Y
(ii)	Saldo principal pendiente serie B ≥ 6,60% Saldo Principal Pendiente Series A, B y C			06.10.2023	%(C / E)	≥ 6,60%	23,56%		S/Y
2.3.2	Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (*)								S/Y
(i)	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no fallidos) <1,00% Saldo Vivo Cartera Hipotecaria			06.10.2023	%(b / (a-d))	< 1,000%	0,378%		S/Y
(ii)	Saldo principal pendiente serie C ≥ 8,00% Saldo Principal Pendiente Series A, B y C			06.10.2023	%(D / E)	≥ 8,00%	28,56%		S/Y
2.4	Reducción Fondo Reserva Requerido: condiciones (**)								N
	Required Cash Reserve reduction: conditions								
(i)	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no fallidos) ≥ 1,00% Saldo Vivo Cartera Hipotecaria			06.10.2023	%(b / (a-d))	≥ 1,00%	0,378%		N
(ii)	F. Reserva Requerido en F.Pago actual hubiese sido dotado en su totalidad			17.07.2023	(n - m)	< 0,00	-28.000.000,00		S/Y
(iii)	Hayan transcurrido 3 años desde la Constitución			16.10.2023	09.03.2007	años/years ≤ 3,00	16,62		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
					06.10.2023	%((a-d)/f)	< 10,00%	10,04%	N

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