

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

Actual / Current **20.09.2023**
 Actual / Current **13.09.2023**
 Precedente / Preceding **20.06.2023**
19.06.2009

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	(b + c + d)	Actual	12.024.684,59		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans	(>3 y <12 meses) (>3 y <12 meses)	Actual Current	37.787,80	% (b / (a - d))	0,316%
c	Préstamo fallidos Failed Loans		Actual Current	117.126,86	% ((c+d) / (a-d))	1,669%
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥12 meses) (≥12 months)	Actual Current	82.190,32		
e	Retención para Amortización de las Series AG, B(CA), C(CA) Series AG, B(CA), C(CA) Amortisation Withholding		Actual Current	1.463.715,26		
f	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CA), C(CA) Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CA), C(CA)		Actual Current	1.463.715,26		
g	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency		Actual Current	0,00		
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		Initial	277.017.643,68		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase AG Outstanding Principal Balance Class A	Precedente	20.06.2023	406.210,00		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CA) Outstanding Principal Balance Series B(CA)	Precedente	20.06.2023	9.800.000,00		
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CA) Outstanding Principal Balance Series C(CA)	Precedente	20.06.2023	3.200.000,00		
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CA) Outstanding Principal Balance Series D(CA)	Precedente	20.06.2023	3.168.108,20		
E	Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CA) y C (CA) Outstanding Principal Balance Series AG, B (CA), C(CA)	Precedente	20.06.2023	13.406.210,00		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido CA Required Cash Reserve CA	Precedente	20.06.2023	3.050.000,00		
n	Fondo de Reserva dotado CA Provisioned Cash Reserve CA	Precedente	20.06.2023	3.050.000,00	(n - m)	0,00
o	Fondo de Reserva Requerido CA / Required Cash Reserve CA	Actual / Currently	20.09.2023	3.050.000,00		
p	Fondo de Reserva dotado CA / Provisioned Cash Reserve CA	Actual / Currently	20.09.2023	3.050.000,00	(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
--------------------------	-----------------------	------------------------	-----------------------------------	-------------------------

2.2 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 / Series B

20.09.2023 g > (50%* B) + C 8.100.000,00 N

2.2.2 Serie C / Series C

20.09.2023 g > (50%* C) 1.600.000,00 N

2.3 Fondo de Reserva:

Cash Reserve:

2.3.1 Condiciones de no reducción

Conditions Cash Reserve reduction(**)

NO PROCEDE POR ESTAR EN EL MINIMO

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
13.09.2023	% ((a-d) / h)	< 10,00%	4,31%	SI

(**) No procede reducción si se da alguna de las condiciones / Do not proceed reduction if any condition concurs

(*) Condición Global de todos los cedentes.

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
19.06.2009

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	(b + c + d)	Actual	3.884.809,94		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans	(>3 y <12 meses)	Actual	0,00	% (b / (a - d))	0,000%
c	Préstamo fallidos Failed Loans	(>3 y <12 meses)	Actual	104.297,87	% ((c+d) / (a-d))	4,054%
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥12 meses)	Actual	51.130,16		
e	Retención para Amortización de las Series AG, B(CM), C(CM) Series AG, B(CM), C(CM) Amortisation Withholding		Actual	452.644,17		
f	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CM), C(CM) Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CM), C(CM)		Actual	452.644,17		
g	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency		Actual	0,00		
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		Initial	74.458.609,46		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase AG Outstanding Principal Balance Class A	Precedente	20.06.2023	0,00		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CM) Outstanding Principal Balance Series B(CM)	Precedente	20.06.2023	1.986.324,12		
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CM) Outstanding Principal Balance Series C(CM)	Precedente	20.06.2023	2.300.000,00		
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CM) Outstanding Principal Balance Series D(CM)	Precedente	20.06.2023	2.173.162,25		
E	Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CM) y C (CM) Outstanding Principal Balance Series AG, B (CM), C(CM)	Precedente	20.06.2023	4.286.324,12		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido CM Required Cash Reserve CM	Precedente	20.06.2023	1.922.166,70		
n	Fondo de Reserva dotado CM Provisioned Cash Reserve CM	Precedente	20.06.2023	1.922.166,70	(n - m)	0,00
o	Fondo de Reserva Requerido CM / Required Cash Reserve CM	Actual / Currently	20.09.2023	1.922.166,70		
p	Fondo de Reserva dotado CM / Provisioned Cash Reserve CM	Actual / Currently	20.09.2023	1.922.166,70	(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
--------------------------	-----------------------	------------------------	-----------------------------------	-------------------------

2.2 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 / Series B

20.09.2023 g > (50%* B) + C 3.293.162,06 N

2.2.2 Serie C / Series C

20.09.2023 g > (50%* C) 1.150.000,00 N

2.3 Fondo de Reserva:

Cash Reserve:

2.3.1 Condiciones de no reducción

Conditions Cash Reserve reduction(**)

(i)	No hayan pasado 3 años desde Constitución Fondo	20.09.2023	19.06.2009	años/years < 3,00	14,26	N
(ii)	No Nivel Mínimo TODOS Fondos Reserva Fecha Pago anterior *	20.06.2023	(n - m)	< 0,00	0,00	N
(iii)	Saldo Vivo Morosos > 1% del Saldo Vivo no Fallidos	13.09.2023	% (b / (a - d))	≥ 1,00%	0,000%	N
(iv)	Préstamos fallidos > 1% del Saldo Vivo no Fallidos	13.09.2023	% ((c+d) / (a-d))	≥ 1,00%	4,054%	S/Y

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
13.09.2023	% ((a-d) / h)	< 10,00%	5,15%	S/Y

(**) No procede reducción si se da alguna de las condiciones / Do not proceed reduction if any condition concurs

(*) Condición Global de todos los cedentes.

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
19.06.2009

1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation
1.1 Datos: Préstamos Hipotecarios / Data: Mortgage Loans

a	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios	(b + c + d)	Actual			1.141.150,43	
	Outstanding Balance Mortgage Loans		Current				
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos	(>3 y <12 meses)	Actual	13.09.2023		186,10	% (b / (a - d))
	Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans	(>3 y <12 meses)	Current				
c	Préstamo fallidos		Actual	13.09.2023		17.466,76	% ((c+d) / (a-d))
	Failed Loans		Current				
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos	(≥12 meses)	Actual	13.09.2023		48.513,63	
	Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥12 months)	Current				
e	Retención para Amortización de las Series AG, B(CT), C(CT)		Actual	13.09.2023		135.478,50	
	Series AG, B(CT), C(CT) Amortisation Withholding		Current				
f	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CT), C(CT)		Actual	13.09.2023		135.478,50	
	Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CT), C(CT)		Current				
g	Déficit de Amortización		Actual	20.09.2023		0,00	
	Amortisation Deficiency		Current				
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios		Initial	19.06.2009		47.531.480,66	
	Outstanding Balance Mortgage Loans						

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase AG	Precedente	20.06.2023		0,00	
	Outstanding Principal Balance Class A	Preceding				
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CT)	Precedente	20.06.2023		0,00	
	Outstanding Principal Balance Series B(CT)	Preceding				
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CT)	Precedente	20.06.2023		1.228.115,40	
	Outstanding Principal Balance Series C(CT)	Preceding				
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CT)	Precedente	20.06.2023		1.020.809,44	
	Outstanding Principal Balance Series D(CT)	Preceding				
E	Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CT) y C (CT)	Precedente	20.06.2023		1.228.115,40	
	Outstanding Principal Balance Series AG, B (CT), C(CT)	Preceding				

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido CT	Precedente	20.06.2023		700.000,00	
	Required Cash Reserve CT	Preceding				
n	Fondo de Reserva dotado CT	Precedente	20.06.2023		700.000,00	(n - m)
	Provisioned Cash Reserve CT	Preceding				
o	Fondo de Reserva Requerido CT / Required Cash Reserve CT	Actual / Currently	20.09.2023		700.000,00	
p	Fondo de Reserva dotado CT / Provisioned Cash Reserve CT	Actual / Currently	20.09.2023		700.000,00	(p - o)

2 Situación disparadores / Triggers status

Fecha datos	Disparador	Condición	Valor Disparador	Actúa S/N
Data date	Trigger	Condition	Trigger value	Breach Y/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 / Series B

20.09.2023 g > (50%* B) + C 1.228.115,40 N

2.2.2 Serie C / Series C

20.09.2023 g > (50%* C) 614.057,70 N

2.3 Fondo de Reserva:

Cash Reserve:

2.3.1 Condiciones de no reducción

Conditions Cash Reserve reduction(**)

NO PROCEDE POR ESTAR EN EL MINIMO

3 Amortización Anticipada opcional / Optional Early Amortization

Fecha datos	Disparador	Condición /Condition	Valor Disparador	Opción Ejercitable S/N
Data date	Trigger	Condition /Condition	Trigger value	Exercisable Option Y/N
13.09.2023	% ((a-d) / h)	< 10,00%	2,30%	S/Y

(**) No procede reducción si se da alguna de las condiciones / Do not proceed reduction if any condition concurs

(*) Condición Global de todos los cedentes.

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
 19.06.2009

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	(b + c + d) Actual 922.720,28		
b Saldo Vivo Préstamos Morosos Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans	(>3 y <12 meses) Actual 0,00	% (b / (a - d))	0,000%
c Préstamo fallidos Failed Loans	(>3 y <12 meses) Actual 28.949,22	% ((c+d) / (a-d))	5,260%
d Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥12 meses) Actual 18.610,77		
e Retención para Amortización de las Series AG, B(CP), C(CP) Series AG, B(CP), C(CP) Amortisation Withholding	(≥12 months) Actual 194.405,70		
f Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CP), C(CP) Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CP), C(CP)	Actual 194.405,70		
g Déficit de Amortización Amortisation Deficiency	Actual 0,00		
h Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans	19.06.2009 Initial 55.764.028,90		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A Saldo Principal Pendiente Clase AG Outstanding Principal Balance Class A	Precedente 20.06.2023 0,00		
B Saldo Principal Pendiente Serie B (CP) Outstanding Principal Balance Series B(CP)	Precedente 20.06.2023 0,00		
C Saldo Principal Pendiente Serie C (CP) Outstanding Principal Balance Series C(CP)	Precedente 20.06.2023 1.098.515,25		
D Saldo Principal Pendiente Serie D (CP) Outstanding Principal Balance Series D(CP)	Precedente 20.06.2023 899.208,16		
E Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CP) y C (CP) Outstanding Principal Balance Series AG, B (CP), C(CP)	Precedente 20.06.2023 1.098.515,25		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m Fondo de Reserva Requerido CP Required Cash Reserve CP	Precedente 20.06.2023 800.000,00		
n Fondo de Reserva dotado CP Provisioned Cash Reserve CP	Precedente 20.06.2023 800.000,00	(n - m)	0,00
o Fondo de Reserva Requerido CP / Required Cash Reserve CP	Actual / Currently 20.09.2023 800.000,00		
p Fondo de Reserva dotado CP / Provisioned Cash Reserve CP	Actual / Currently 20.09.2023 800.000,00	(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
--------------------------	-----------------------	------------------------	-----------------------------------	-------------------------

2.2 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 / Series B

2.2.2 Serie C / Series C

20.09.2023	g	> (50%* B) + C	1.098.515,25	N
20.09.2023	g	> (50%* C)	549.257,63	N

2.3 Fondo de Reserva:

Cash Reserve:

2.3.1 Condiciones de no reducción

Conditions Cash Reserve reduction(**)

NO PROCEDE POR ESTAR EN EL MINIMO

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
13.09.2023	% ((a-d) / h)	< 10,00%	1,62%	SI/Y

(**) No procede reducción si se da alguna de las condiciones / Do not proceed reduction if any condition concurs

(*) Condición Global de todos los cedentes.