

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

Actual / Current 20.12.2023
 Actual / Current 13.12.2023
 Precedente / Preceding 20.09.2023
 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 Current	10.614.607,16		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans	(>3 y <12 meses) (>3 y <12 meses)	Actual Current	39.559,16	% (b / (a - d))	0,376%
c	Préstamo fallidos Failed Loans		Actual Current	82.236,84	% ((c+d) / (a-d))	1,561%
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	1.410.077,90		
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	1.410.077,90		
g	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency		Actual Current	0,00		
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		Initial 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 Preceding	20.09.2023	0,00		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CA) Outstanding Principal Balance Series B(CA)	Precedente Preceding	20.09.2023	8.742.494,74		
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CA) Outstanding Principal Balance Series C(CA)	Precedente Preceding	20.09.2023	3.200.000,00		
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CA) Outstanding Principal Balance Series D(CA)	Precedente Preceding	20.09.2023	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 Preceding	20.09.2023	11.942.494,74		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido CA Required Cash Reserve CA	Precedente Preceding	20.09.2023	3.050.000,00		
n	Fondo de Reserva dotado CA Provisioned Cash Reserve CA	Precedente Preceding	20.09.2023	3.050.000,00	(n - m)	0,00
o	Fondo de Reserva Requerido CA / Required Cash Reserve CA	Actual / Currently Actual / Currently	20.12.2023	3.050.000,00		
p	Fondo de Reserva dotado CA / Provisioned Cash Reserve CA		20.12.2023	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

20.12.2023 g > (50%* B) + C 7.571.247,37 N

2.2.2 Serie C / Series C

20.12.2023 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
13.12.2023	% ((a-d) / h)	< 10,00%	3,80%	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
 20.12.2023
 13.12.2023
 20.09.2023
 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
	Outstanding Balance Mortgage Loans		Current
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos	(>3 y <12 meses)	Actual
	Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans	(>3 y <12 meses)	Current
c	Préstamo fallidos		Actual
	Failed Loans		Current
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos	(≥12 meses)	Actual
	Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥12 months)	Current
e	Retención para Amortización de las Series AG, B(CM), C(CM)		Actual
	Series AG, B(CM), C(CM) Amortisation Withholding		Current
f	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CM), C(CM)		Actual
	Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CM), C(CM)		Current
g	Déficit de Amortización		Actual
	Amortisation Deficiency		Current
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios		Inicial
	Outstanding Balance Mortgage Loans		Initial

Fecha datos	Valor / Importe	Cálculo Ratio	Ratio (valor)
Data date	Value / Amount	Ratio calculation	Ratio (value)

	3.429.141,24		
13.12.2023	0,00	% (b / (a - d))	0,000%
13.12.2023	104.297,87	% ((c+d) / (a-d))	3,337%
13.12.2023	9.804,88		
13.12.2023	414.343,38		
13.12.2023	414.343,38		
20.12.2023	0,00		
19.06.2009	74.458.609,46		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase AG		Precedente
	Outstanding Principal Balance Class A		Preceding
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CM)		Precedente
	Outstanding Principal Balance Series B(CM)		Preceding
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CM)		Precedente
	Outstanding Principal Balance Series C(CM)		Preceding
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CM)		Precedente
	Outstanding Principal Balance Series D(CM)		Preceding
E	Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CM) y C (CM)		Precedente
	Outstanding Principal Balance Series AG, B (CM), C(CM)		Preceding

20.09.2023		0,00		
20.09.2023		1.533.679,95		
20.09.2023		2.300.000,00		
20.09.2023		2.173.162,25		
20.09.2023		3.833.679,95		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido CM		Precedente
	Required Cash Reserve CM		Preceding
n	Fondo de Reserva dotado CM		Precedente
	Provisioned Cash Reserve CM		Preceding
o	Fondo de Reserva Requerido CM / Required Cash Reserve CM		Actual / Currently
p	Fondo de Reserva dotado CM / Provisioned Cash Reserve CM		Actual / Currently

20.09.2023		1.922.166,70		
20.09.2023		1.922.166,70	(n - m)	0,00
20.12.2023		1.922.166,70		
20.12.2023		1.922.166,70	(p - o)	0,00

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

20.12.2023	g	> (50%* B) + C	3.066.839,98	N
------------	---	----------------	--------------	---

2.2.2 Serie C / Series C

20.12.2023	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
- (ii) No Nivel Mínimo TODOS Fondos Reserva Fecha Pago anterior *
- (iii) Saldo Vivo Morosos > 1% del Saldo Vivo no Fallidos
- (iv) Préstamos fallidos > 1% del Saldo Vivo no Fallidos

20.12.2023	19.06.2009	años/years < 3,00	14,51	N
20.09.2023	(n - m)	< 0,00	0,00	N
13.12.2023	% (b / (a - d))	≥ 1,00%	0,000%	N
13.12.2023	% ((c+d) / (a-d))	≥ 1,00%	3,337%	S/Y

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

13.12.2023	% ((a-d) / h)	< 10,00%	4,59%	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 **20.12.2023**
 Actual / Current **13.12.2023**
 Precedente / Preceding **20.09.2023**
19.06.2009

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

			Fecha datos <i>Data date</i>	Valor / Importe <i>Value / Amount</i>	Cálculo Ratio <i>Ratio calculation</i>	Ratio (valor) <i>Ratio (value)</i>
a	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>	(b + c + d)	Actual	1.027.851,46		
			Current			
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans</i>	(>3 y <12 meses)	Actual	0,00	% (b / (a - d))	0,000%
			Current			
c	Préstamo fallidos <i>Failed Loans</i>	(>3 y <12 meses)	Actual	17.466,76	% ((c+d) / (a-d))	6,758%
			Current			
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	(≥12 meses)	Actual	48.699,73		
			Current			
e	Retención para Amortización de las Series AG, B(CT), C(CT) <i>Series AG, B(CT), C(CT) Amortisation Withholding</i>		Actual	113.485,05		
			Current			
f	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CT), C(CT) <i>Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CT), C(CT)</i>		Actual	113.485,05		
			Current			
g	Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i>		Actual	0,00		
			Current			
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>		Inicial	47.531.480,66		
			Initial			

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase AG <i>Outstanding Principal Balance Class A</i>	Precedente	20.09.2023	0,00		
		Preceding				
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CT) <i>Outstanding Principal Balance Series B(CT)</i>	Precedente	20.09.2023	0,00		
		Preceding				
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CT) <i>Outstanding Principal Balance Series C(CT)</i>	Precedente	20.09.2023	1.092.636,90		
		Preceding				
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CT) <i>Outstanding Principal Balance Series D(CT)</i>	Precedente	20.09.2023	1.020.809,44		
		Preceding				
E	Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CT) y C (CT) <i>Outstanding Principal Balance Series AG, B (CT), C(CT)</i>	Precedente	20.09.2023	1.092.636,90		
		Preceding				

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido CT <i>Required Cash Reserve CT</i>	Precedente	20.09.2023	700.000,00		
		Preceding				
n	Fondo de Reserva dotado CT <i>Provisioned Cash Reserve CT</i>	Precedente	20.09.2023	700.000,00	(n - m)	0,00
		Preceding				
o	Fondo de Reserva Requerido CT / <i>Required Cash Reserve CT</i>	Actual / Currently	20.12.2023	700.000,00		
p	Fondo de Reserva dotado CT / <i>Provisioned Cash Reserve CT</i>	Actual / Currently	20.12.2023	700.000,00	(p - o)	0,00

2 Situación disparadores / Triggers status

Fecha datos <i>Data date</i>	Disparador <i>Trigger</i>	Condición <i>Condition</i>	Valor Disparador <i>Trigger value</i>	Actúa S/N <i>Breach Y/N</i>
--	-------------------------------------	--------------------------------------	---	---------------------------------------

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 C / Series C

20.12.2023 g > (50%* C) 546.318,45 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 <i>Data date</i>	Disparador <i>Trigger</i>	Condición /Condition	Valor Disparador <i>Trigger value</i>	Opción Ejercitable S/N <i>Exercisable Option Y/N</i>
13.12.2023	% ((a-d) / h)	< 10,00%	2,06%	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 20.12.2023
Actual / Current 13.12.2023
Precedente / Preceding 20.09.2023
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 Current	749.047,79		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans	(>3 y <12 meses) (>3 y <12 meses)	Actual Current	13.12.2023 3.596,22	% (b / (a - d))	0,492%
c	Préstamo fallidos Failed Loans		Actual Current	13.12.2023 28.949,22	% ((c+d) / (a-d))	6,511%
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥12 meses) (≥12 months)	Actual Current	13.12.2023 18.610,77		
e	Retención para Amortización de las Series AG, B(CP), C(CP) Series AG, B(CP), C(CP) Amortisation Withholding		Actual Current	13.12.2023 173.672,40		
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 Current	13.12.2023 173.672,40		
g	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency		Actual Current	20.12.2023 0,00		
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		Precedente Initial	19.06.2009 55.764.028,90		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase AG Outstanding Principal Balance Class A	Precedente	20.09.2023	0,00		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CP) Outstanding Principal Balance Series B(CP)	Precedente	20.09.2023	0,00		
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CP) Outstanding Principal Balance Series C(CP)	Precedente	20.09.2023	904.109,55		
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CP) Outstanding Principal Balance Series D(CP)	Precedente	20.09.2023	899.208,16		
E	Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CP) y C (CP) Outstanding Principal Balance Series AG, B (CP), C(CP)	Precedente	20.09.2023	904.109,55		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido CP Required Cash Reserve CP	Precedente	20.09.2023	800.000,00		
n	Fondo de Reserva dotado CP Provisioned Cash Reserve CP	Precedente	20.09.2023	800.000,00	(n - m)	0,00
o	Fondo de Reserva Requerido CP / Required Cash Reserve CP	Actual / Currently	20.12.2023	800.000,00		
p	Fondo de Reserva dotado CP / Provisioned Cash Reserve CP	Actual / Currently	20.12.2023	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 C / Series C

20.12.2023 q > (50%* C) 452.054,78 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
13.12.2023	% ((a-d) / h)	< 10,00%	1,31%	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.