

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

Actual / Current **20.06.2024**
 Actual / Current **13.06.2024**
 Precedente / Preceding **20.03.2024**
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	7.873.820,72		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans	(>3 y <12 meses) (>3 y <12 meses)	Actual Current	13.06.2024 62.449,57	% (b / (a - d))	0,799%
c	Préstamo fallidos Failed Loans		Actual Current	13.06.2024 82.236,84	% ((c+d) / (a-d))	1,849%
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥12 meses) (≥12 months)	Actual Current	13.06.2024 62.215,57		
e	Retención para Amortización de las Series AG, B(CA), C(CA) Series AG, B(CA), C(CA) Amortisation Withholding		Actual Current	13.06.2024 1.309.552,44		
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	13.06.2024 1.309.552,44		
g	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency		Actual Current	20.06.2024 0,00		
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		Initial	19.06.2009 277.017.643,68		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase AG Outstanding Principal Balance Class A	Precedente	20.03.2024	0,00		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CA) Outstanding Principal Balance Series B(CA)	Precedente	20.03.2024	5.921.158,04		
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CA) Outstanding Principal Balance Series C(CA)	Precedente	20.03.2024	3.200.000,00		
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CA) Outstanding Principal Balance Series D(CA)	Precedente	20.03.2024	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	20.03.2024	9.121.158,04		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido CA Required Cash Reserve CA	Precedente	20.03.2024	3.050.000,00		
n	Fondo de Reserva dotado CA Provisioned Cash Reserve CA	Precedente	20.03.2024	3.050.000,00	(n - m)	0,00
o	Fondo de Reserva Requerido CA / Required Cash Reserve CA	Actual / Currently	20.06.2024	3.050.000,00		
p	Fondo de Reserva dotado CA / Provisioned Cash Reserve CA	Actual / Currently	20.06.2024	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

20.06.2024 g > (50%* B) + C 6.160.579,02 N

2.2.2 Serie C / Series C

20.06.2024 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
13.06.2024	% ((a-d) / h)	< 10,00%	2,82%	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
 20.06.2024
 13.06.2024
 20.03.2024
 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 <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>	(b + c + d) Actual		2.707.435,08		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans</i>	(>3 y <12 meses) Actual	13.06.2024	5.124,91	% (b / (a - d))	0,190%
c	Préstamo fallidos <i>Failed Loans</i>	(>3 y <12 meses) Actual	13.06.2024	104.297,87	% ((c+d) / (a-d))	4,230%
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	(≥12 meses) Actual	13.06.2024	9.804,88		
e	Retención para Amortización de las Series AG, B(CM), C(CM) <i>Series AG, B(CM), C(CM) Amortisation Withholding</i>	Actual	13.06.2024	335.286,60		
f	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CM), C(CM) <i>Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CM), C(CM)</i>	Actual	13.06.2024	335.286,60		
g	Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i>	Actual	20.06.2024	0,00		
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>	Inicial	19.06.2009	74.458.609,46		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase AG <i>Outstanding Principal Balance Class A</i>	Precedente	20.03.2024	0,00		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CM) <i>Outstanding Principal Balance Series B(CM)</i>	Precedente	20.03.2024	732.916,80		
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CM) <i>Outstanding Principal Balance Series C(CM)</i>	Precedente	20.03.2024	2.300.000,00		
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CM) <i>Outstanding Principal Balance Series D(CM)</i>	Precedente	20.03.2024	2.173.162,25		
E	Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CM) y C (CM) <i>Outstanding Principal Balance Series AG, B (CM), C(CM)</i>	Precedente	20.03.2024	3.032.916,80		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido CM <i>Required Cash Reserve CM</i>	Precedente	20.03.2024	1.922.166,70		
n	Fondo de Reserva dotado CM <i>Provisioned Cash Reserve CM</i>	Precedente	20.03.2024	1.922.166,70	(n - m)	0,00
o	Fondo de Reserva Requerido CM / <i>Required Cash Reserve CM</i>	Actual / Currently	20.06.2024	1.922.166,70		
p	Fondo de Reserva dotado CM / <i>Provisioned Cash Reserve CM</i>	Actual / Currently	20.06.2024	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

20.06.2024 g > (50%* B) + C 2.666.458,40 N

2.2.2 Serie C / Series C

20.06.2024 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	20.06.2024	19.06.2009	años/years < 3,00	15,01	N
(ii)	No Nivel Mínimo TODOS Fondos Reserva Fecha Pago anterior *	20.03.2024	(n - m)	< 0,00	0,00	N
(iii)	Saldo Vivo Morosos > 1% del Saldo Vivo no Fallidos	13.06.2024	% (b / (a - d))	≥ 1,00%	0,190%	N
(iv)	Préstamos fallidos > 1% del Saldo Vivo no Fallidos	13.06.2024	% ((c+d) / (a-d))	≥ 1,00%	4,230%	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
13.06.2024	% ((a-d) / h)	< 10,00%	3,62%	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		779.922,34		
	Outstanding Balance Mortgage Loans		Current				
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos	(>3 y <12 meses)	Actual	13.06.2024	0,00	% (b / (a - d))	0,000%
	Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans	(>3 y <12 meses)	Current				
c	Préstamo fallidos		Actual	13.06.2024	17.466,76	% ((c+d) / (a-d))	9,049%
	Failed Loans		Current				
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos	(≥12 meses)	Actual	13.06.2024	48.699,73		
	Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥12 months)	Current				
e	Retención para Amortización de las Series AG, B(CT), C(CT)		Actual	13.06.2024	98.556,75		
	Series AG, B(CT), C(CT) Amortisation Withholding		Current				
f	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CT), C(CT)		Actual	13.06.2024	98.556,75		
	Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CT), C(CT)		Current				
g	Déficit de Amortización		Actual	20.06.2024	0,00		
	Amortisation Deficiency		Current				
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios		19.06.2009		47.531.480,66		
	Outstanding Balance Mortgage Loans		Initial				

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase AG	Precedente	20.03.2024	0,00		
	Outstanding Principal Balance Class A	Preceding				
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CT)	Precedente	20.03.2024	0,00		
	Outstanding Principal Balance Series B(CT)	Preceding				
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CT)	Precedente	20.03.2024	829.779,45		
	Outstanding Principal Balance Series C(CT)	Preceding				
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CT)	Precedente	20.03.2024	1.020.809,44		
	Outstanding Principal Balance Series D(CT)	Preceding				
E	Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CT) y C (CT)	Precedente	20.03.2024	829.779,45		
	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	20.03.2024	700.000,00		
	Required Cash Reserve CT	Preceding				
n	Fondo de Reserva dotado CT	Precedente	20.03.2024	700.000,00	(n - m)	0,00
	Provisioned Cash Reserve CT	Preceding				
o	Fondo de Reserva Requerido CT / Required Cash Reserve CT	Actual / Currently	20.06.2024	700.000,00		
p	Fondo de Reserva dotado CT / Provisioned Cash Reserve CT	Actual / Currently	20.06.2024	700.000,00	(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

20.06.2024 g > (50%* B) + C 829.779,45 N

2.2.2 Serie C / Series C

20.06.2024 g > (50%* C) 414.889,73 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
13.06.2024	% ((a-d) / h)	< 10,00%	1,54%	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 20.06.2024
Actual / Current 13.06.2024
Precedente / Preceding 20.03.2024
19.06.2009

1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation

1.1 Datos: Préstamos Hipotecarios / Data: Mortgage Loans

Fecha datos	Valor / Importe	Cálculo Ratio	Ratio (valor)
Data date	Value / Amount	Ratio calculation	Ratio (value)
a Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans	(b + c + d) Actual 528.858,07		
b Saldo Vivo Préstamos Morosos Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans	(>3 y <12 meses) Current 6.407,66	% (b / (a - d))	1,256%
c Préstamo fallidos Failed Loans	(>3 y <12 meses) Current 28.949,22	% ((c+d) / (a-d))	9,321%
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	Current 83.388,15		
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 83.388,15		
g Déficit de Amortización Amortisation Deficiency	Actual 20.06.2024 0,00		
h Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans	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 20.03.2024 0,00		
B Saldo Principal Pendiente Serie B (CP) Outstanding Principal Balance Series B(CP)	Precedente 20.03.2024 0,00		
C Saldo Principal Pendiente Serie C (CP) Outstanding Principal Balance Series C(CP)	Precedente 20.03.2024 593.635,50		
D Saldo Principal Pendiente Serie D (CP) Outstanding Principal Balance Series D(CP)	Precedente 20.03.2024 899.208,16		
E Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CP) y C (CP) Outstanding Principal Balance Series AG, B (CP), C(CP)	Precedente 20.03.2024 593.635,50		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m Fondo de Reserva Requerido CP Required Cash Reserve CP	Precedente 20.03.2024 800.000,00		
n Fondo de Reserva dotado CP Provisioned Cash Reserve CP	Precedente 20.03.2024 800.000,00	(n - m)	0,00
o Fondo de Reserva Requerido CP / Required Cash Reserve CP	Actual / Currently 20.06.2024 800.000,00		
p Fondo de Reserva dotado CP / Provisioned Cash Reserve CP	Actual / Currently 20.06.2024 800.000,00	(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

2.2.2 Serie C / Series C

20.06.2024	g	> (50%* B) + C	593.635,50	N
20.06.2024	g	> (50%* C)	296.817,75	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

13.06.2024	% ((a-d) / h)	< 10,00%	0,92%	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.