

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
Actual / Current
Precedente / Preceding

20.09.2024
13.09.2024
20.06.2024
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	6.776.581,71		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans</i>	(>3 y <12 meses) (>3 y <12 meses)	Actual Current	67.096,02	% (b / (a - d))	0,997%
c	Préstamo fallidos <i>Failed Loans</i>		Actual Current	82.036,84	% ((c+d) / (a-d))	1,921%
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	(≥12 meses) (≥12 months)	Actual Current	47.233,67		
e	Retención para Amortización de las Series AG, B(CA), C(CA) <i>Series AG, B(CA), C(CA) Amortisation Withholding</i>		Actual Current	1.082.257,12		
f	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CA), C(CA) <i>Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CA), C(CA)</i>		Actual Current	1.082.257,12		
g	Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i>		Actual Current	0,00		
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>		Initial	277.017.643,68		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase AG <i>Outstanding Principal Balance Class A</i>		Precedente Preceding	20.06.2024	0,00	
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CA) <i>Outstanding Principal Balance Series B(CA)</i>		Precedente Preceding	20.06.2024	4.611.605,60	
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CA) <i>Outstanding Principal Balance Series C(CA)</i>		Precedente Preceding	20.06.2024	3.200.000,00	
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CA) <i>Outstanding Principal Balance Series D(CA)</i>		Precedente Preceding	20.06.2024	3.168.108,20	
E	Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CA) y C (CA) <i>Outstanding Principal Balance Series AG, B (CA), C(CA)</i>		Precedente Preceding	20.06.2024	7.811.605,60	

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido CA <i>Required Cash Reserve CA</i>		Precedente Preceding	20.06.2024	3.050.000,00	
n	Fondo de Reserva dotado CA <i>Provisioned Cash Reserve CA</i>		Precedente Preceding	20.06.2024	3.050.000,00	(n - m) 0,00
o	Fondo de Reserva Requerido CA / Required Cash Reserve CA		Actual / Currently	20.09.2024	3.050.000,00	
p	Fondo de Reserva dotado CA / Provisioned Cash Reserve CA		Actual / Currently	20.09.2024	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	20.09.2024	g	> (50%* B) + C	5.505.802,80	N
2.2.2 Serie C / Series C	20.09.2024	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

Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición /Condition	Valor Disparador Trigger value	Opción Ejercitable S/N Exercisable Option Y/N
13.09.2024	% ((a-d) / h)	< 10,00%	2,43%	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	2.404.503,36		
			Current			
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans	(>3 y <12 meses) (>3 y <12 meses)	Actual	13.09.2024	24.053,52	% (b / (a - d))
			Current			1,004%
c	Préstamo fallidos Failed Loans		Actual	13.09.2024	104.297,87	% ((c+d) / (a-d))
			Current			4,765%
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥12 meses) (≥12 months)	Actual	13.09.2024	9.804,88	
			Current			
e	Retención para Amortización de las Series AG, B(CM), C(CM) Series AG, B(CM), C(CM) Amortisation Withholding		Actual	13.09.2024	302.931,42	
			Current			
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	13.09.2024	302.931,42	
			Current			
g	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency		Actual	20.09.2024	0,00	
			Current			
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		Precedente	19.06.2009	74.458.609,46	
			Initial			

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase AG Outstanding Principal Balance Class A		Precedente	20.06.2024	0,00	
			Preceding			
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CM) Outstanding Principal Balance Series B(CM)		Precedente	20.06.2024	397.630,20	
			Preceding			
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CM) Outstanding Principal Balance Series C(CM)		Precedente	20.06.2024	2.300.000,00	
			Preceding			
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CM) Outstanding Principal Balance Series D(CM)		Precedente	20.06.2024	2.173.162,25	
			Preceding			
E	Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CM) y C (CM) Outstanding Principal Balance Series AG, B (CM), C(CM)		Precedente	20.06.2024	2.697.630,20	
			Preceding			

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido CM Required Cash Reserve CM		Precedente	20.06.2024	1.922.166,70	
			Preceding			
n	Fondo de Reserva dotado CM Provisioned Cash Reserve CM		Precedente	20.06.2024	1.922.166,70	(n - m)
			Preceding			0,00
o	Fondo de Reserva Requerido CM / Required Cash Reserve CM		Actual / Currently	20.09.2024	1.922.166,70	
			Actual / Currently	20.09.2024	1.922.166,70	(p - o)
p	Fondo de Reserva dotado CM / Provisioned Cash Reserve CM					0,00

2 Situación disparadores / Triggers status

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

20.09.2024	g	> (50%* B) + C	2.498.815,10	N
20.09.2024	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					N
(ii)	No Nivel Mínimo TODOS Fondos Reserva Fecha Pago anterior *					N
(iii)	Saldo Vivo Morosos > 1% del Saldo Vivo no Fallidos					S/Y
(iv)	Préstamos fallidos > 1% del Saldo Vivo no Fallidos					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
13.09.2024	% ((a-d) / h)	< 10,00%	3,22%	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	665.378,49		
			Current			
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans	(>3 y <12 meses) (>3 y <12 meses)	Actual	13.09.2024	0,00	% (b / (a - d))
			Current			0,000%
c	Préstamo fallidos Failed Loans		Actual	13.09.2024	17.466,76	% ((c+d) / (a-d))
			Current			10,729%
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥12 meses) (≥12 months)	Actual	13.09.2024	48.699,73	
			Current			
e	Retención para Amortización de las Series AG, B(CT), C(CT) Series AG, B(CT), C(CT) Amortisation Withholding		Actual	13.09.2024	114.543,90	
			Current			
f	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CT), C(CT) Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CT), C(CT)		Actual	13.09.2024	114.543,90	
			Current			
g	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency		Actual	20.09.2024	0,00	
			Current			
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		Initial	19.06.2009	47.531.480,66	
			Initial			

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase AG Outstanding Principal Balance Class A	Precedente	20.06.2024	0,00		
		Preceding				
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CT) Outstanding Principal Balance Series B(CT)	Precedente	20.06.2024	0,00		
		Preceding				
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CT) Outstanding Principal Balance Series C(CT)	Precedente	20.06.2024	731.222,70		
		Preceding				
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CT) Outstanding Principal Balance Series D(CT)	Precedente	20.06.2024	1.020.809,44		
		Preceding				
E	Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CT) y C (CT) Outstanding Principal Balance Series AG, B (CT), C(CT)	Precedente	20.06.2024	731.222,70		
		Preceding				

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido CT Required Cash Reserve CT	Precedente	20.06.2024	700.000,00		
		Preceding				
n	Fondo de Reserva dotado CT Provisioned Cash Reserve CT	Precedente	20.06.2024	700.000,00	(n - m)	0,00
		Preceding				
o	Fondo de Reserva Requerido CT / Required Cash Reserve CT	Actual / Currently	20.09.2024	700.000,00		
p	Fondo de Reserva dotado CT / Provisioned Cash Reserve CT	Actual / Currently	20.09.2024	700.000,00	(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

20.09.2024 g > (50%* B) + C 731.222,70 N

2.2.2 Serie C / Series C

20.09.2024 g > (50%* C) 365.611,35 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
--------------------------	-----------------------	----------------------	-----------------------------------	--

13.09.2024 % ((a-d) / h) < 10,00% 1,30% SIY

(**) 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 **20.09.2024**
 Actual / Current **13.09.2024**
 Actual / Current **20.06.2024**
 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 <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>	(b + c + d)	Actual	446.368,74		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans</i>	(>3 y <12 meses) (~3 y <12 meses)	Actual	5.242,56	% (b / (a - d))	1,226%
c	Préstamo fallidos <i>Failed Loans</i>		Actual	28.949,22	% ((c+d) / (a-d))	11,118%
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	(≥12 meses) (≥12 months)	Actual	18.610,77		
e	Retención para Amortización de las Series AG, B(CP), C(CP) <i>Series AG, B(CP), C(CP) Amortisation Withholding</i>		Actual	82.489,35		
f	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CP), C(CP) <i>Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CP), C(CP)</i>		Actual	82.489,35		
g	Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i>		Actual	0,00		
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>		Precedente	55.764.028,90		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase AG <i>Outstanding Principal Balance Class A</i>	Precedente	20.06.2024	0,00		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CP) <i>Outstanding Principal Balance Series B(CP)</i>	Precedente	20.06.2024	0,00		
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CP) <i>Outstanding Principal Balance Series C(CP)</i>	Precedente	20.06.2024	510.247,35		
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CP) <i>Outstanding Principal Balance Series D(CP)</i>	Precedente	20.06.2024	899.208,16		
E	Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CP) y C (CP) <i>Outstanding Principal Balance Series AG, B (CP), C(CP)</i>	Precedente	20.06.2024	510.247,35		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido CP <i>Required Cash Reserve CP</i>	Precedente	20.06.2024	800.000,00		
n	Fondo de Reserva dotado CP <i>Provisioned Cash Reserve CP</i>	Precedente	20.06.2024	800.000,00	(n - m)	0,00
o	Fondo de Reserva Requerido CP / <i>Required Cash Reserve CP</i>	Actual / Currently	20.09.2024	800.000,00		
p	Fondo de Reserva dotado CP / <i>Provisioned Cash Reserve CP</i>	Actual / Currently	20.09.2024	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

20.09.2024 g > (50%* B) + C 510.247,35 N

2.2.2 Serie C / Series C

20.09.2024 g > (50%* C) 255.123,68 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
13.09.2024	% ((a-d) / h)	< 10,00%	0,77%	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.