

Fecha de Pago / Payment Date

Actual / Current	18.10.2022
Precedente / Preceding	18.07.2022
Actual / Current	10.10.2022

Fecha de Determinación /

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 Datos: Préstamos Hipotecarios / Data: Mortgage Loans									
a	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans	(b + c + d)	Actual Currently	18.10.2022	96.651.606,04				
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <18 meses) (>3 and <18 months)	Actual Currently	18.10.2022	385.465,15	% (b / e)		0,412%	
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses) (≤3 months)	Actual Currently	18.10.2022	93.167.958,78				
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥18 meses) (≥18 months)	Actual Currently	18.10.2022	3.098.182,11				
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<18 meses) (<18 months)	Actual Currently	18.10.2022	93.553.423,93	% (e / f)		8,78%	
f	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		Initial Initial	26.05.2006	1.065.201.761,38				
g	Retención para Amortización de las Series A, B, C y D Series A, B, C & D Amortisation Withholding		Actual Currently	18.10.2022	5.036.787,64				
h	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A, B, C y D Available Funds applied for Amortization of Series A, B, C & D				5.036.787,64				
i	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency				0,00				
1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue									
A	Saldo Principal Pendiente Serie A Outstanding Principal Balance Series A		Precedente Preceding	18.07.2022	86.890.760,06				
B	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B		Precedente Preceding	18.07.2022	7.438.062,39	% (B / F)		7,544%	
C	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C		Precedente Preceding	18.07.2022	1.639.080,00	% (C / F)		1,663%	
D	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D		Precedente Preceding	18.07.2022	2.622.309,12	% (D / F)		2,660%	
E	Saldo Principal Pendiente Serie E Outstanding Principal Balance Series E		Precedente Preceding	18.07.2022	6.391.200,00				
F	Saldo Principal Pendiente Series A, B, C y D Outstanding Principal Balance Series A, B, C & D		Precedente Preceding	18.07.2022	98.590.211,57				
G	Importe nominal emisión Serie B Issue face amount Series B		Initial Initial	26.05.2006	36.300.000,00				
H	Importe nominal emisión Serie C Issue face amount Series C		Initial Initial	26.05.2006	8.000.000,00				
I	Importe nominal emisión Serie D Issue face amount Series D		Initial Initial	26.05.2006	12.800.000,00				
1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve									
j	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Precedente / Preceding	18.07.2022	6.391.200,00				
k	Fondo de Reserva Dotado / Provisioned Cash Reserve		Precedente / Preceding	18.07.2022	6.391.200,00				
l	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Actual / Currently	18.10.2022	6.391.200,00				
m	Fondo de Reserva Dotado / Provisioned Cash Reserve		Actual / Currently	18.10.2022	6.391.200,00				
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 Pago intereses Series B, C y D: postergación lugar orden de prelación Interest payment of Series B, C & D: place deferred in priority of payments									
2.1.1 Serie B / Series B Déficit Amorti 50%B+100%C y D					18.10.2022	i	> 0,5*B + C + D	7.980.420,32	N
2.1.2 Serie C / Series C Déficit Amortización 50%C+100%D					18.10.2022	i	> 0,5*C + D	3.441.849,12	N
2.1.3 Serie D / Series D Déficit Amortización 50%D					18.10.2022	i	> 0,5*D	1.311.154,56	N
2.2 Fondo de Reserva: Cash Reserve							APLICA MINIMO		
2.3 Amortización a Prorrata Series B, C y D Pro Rata Amortisation of Series B, C & D									
2.3.0 Condiciones comunes / Common conditions (**)									
(i) que en la Fecha de Pago precedente a la Fecha de Pago correspondiente, el Fondo de Reserva hubiera sido dotado en el importe del Fondo de Reserva Requerido a aquella Fecha de Pago,						j-k	= 0,00	0,00	N S/Y
(ii) en la Fecha Determinación anterior a la Fecha de Pago correspondiente, el importe del Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios no Dudosos sea igual o superior al 10 por 100 del Saldo Vivo inicial a la constitución del Fondo.						e/f	≥ 10,00%	8,78%	N
2.3.1 Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (**)									S/Y S/Y
(i) el Saldo de Principal Pendiente de la Serie B sea igual o mayor al 6,816% de la suma del Saldo de Principal Pendiente de las Series A, B, C y D,						B	≥ 6,816%	7,544%	
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 1,25% del Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios no Dudosos.						b/e	≤ 1,25%	0,412%	S/Y
2.3.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (**)									S/Y S/Y
(i) el Saldo de Principal Pendiente de la Serie C sea igual o mayor al 1,502% de la suma del Saldo de Principal Pendiente de las Series A, B, C y D,						C	≥ 1,502%	1,663%	
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 1,00% del Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios no Dudosos.						b/e	≤ 1,00%	0,412%	S/Y
2.3.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (**)									S/Y S/Y
(i) el Saldo de Principal Pendiente de la Serie D sea igual o mayor al 2,403% de la suma del Saldo de Principal Pendiente de las Series A, B, C y D,						D	≥ 2,403%	2,660%	
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 0,75% del Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios no Dudosos.						b/e	≤ 0,75%	0,412%	S/Y

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

(**) Procede la reducción si se dan todas las condiciones

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
26/05/2006	% (a / g)	< 10,00%	9,07%	S/Y