

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
Inicial

20.07.2020
13.07.2020
20.04.2020
26.05.2006

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	13.07.2020	213.342.241,98		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <18 meses) (>3 and <18 months)	Actual Currently	13.07.2020	3.649.103,94	% (b / e)	1,756%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses) (≤3 months)	Actual Currently	13.07.2020	204.112.729,00		
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥18 meses) (≥18 months)	Actual Currently	13.07.2020	5.580.409,04		
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<18 meses) (<18 months)	Actual Currently	13.07.2020	207.761.832,94	% (e / i)	15,98%
f	Retención para Amortización de las Series A, B, C y D Series A, B, C & D Amortisation Withholding		Actual Currently	20.07.2020	6.790.712,23		
g	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A, B, C y D Available Funds applied for Amortization of Series A, B, C & D				6.790.712,23		
h	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency				0,00		
i	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		Inicial Initial	26.05.2006	1.300.020.570,99		
j	Margen medio Ponderado Weighted average margin of Mortgage Loans			20.07.2020	0,880000%		
1.2	Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue						
A	Saldo Principal Pendiente Serie A Outstanding Principal Balance Series A		Precedente Preceding	20.04.2020	193.012.595,00		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B		Precedente Preceding	20.04.2020	9.011.208,57	% (B / F)	4,200%
C	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C		Precedente Preceding	20.04.2020	5.328.741,60	% (C / F)	2,484%
D	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D		Precedente Preceding	20.04.2020	7.200.000,00	% (D / F)	3,356%
E	Saldo Principal Pendiente Serie E Outstanding Principal Balance Series E		Precedente Preceding	20.04.2020	5.850.000,00		
F	Saldo Principal Pendiente Series A, B, C y D Outstanding Principal Balance Series A, B, C & D		Precedente Preceding	20.04.2020	214.552.545,17		
G	Importe nominal emisión Serie B Issue face amount Series B		Inicial Initial		27.300.000,00		
H	Importe nominal emisión Serie C Issue face amount Series C		Inicial Initial		15.600.000,00		
I	Importe nominal emisión Serie D Issue face amount Series D		Inicial Initial		7.200.000,00		
1.3	Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve						
K	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Precedente / Preceding	20.04.2020	5.850.000,00		
n	Fondo de Reserva Dotado		Precedente / Preceding		5.850.000,00		
ñ	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Actual / Current	20.07.2020	5.850.000,00		
o	Fondo de Reserva Dotado		Actual / Current		5.850.000,00		
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		h	> 0,5*B + C + D	17.034.345,89	N	
2.1.2	Serie C / Series C		h	> 0,5*C + D	9.864.370,80	N	
2.1.3	Serie D / Series D		h	> 0,5*D	3.600.000,00	N	
NO APLICA POR ESTAR EN EL MÍNIMO							
2.2	Fondo de Reserva: Cash Reserve						
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,	k-n	= 0,00	0,00		S/Y	
(ii)	en la Fecha Determinación precedente 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.		≥ 10,00%	15,98%		S/Y	
2.3.1	Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (**)						
(i)	el Saldo de Principal Pendiente de la Serie B sea igual o mayor al 4,200% de la suma del Saldo de Principal Pendiente de las Series A1, A2a, A2b, B, C y D,		≥ 4,200%	4,200%		N	
(ii)	el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 1,25% del Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios no Dudosos.		≤ 1,25%	1,756%		N	
2.3.2	Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (**)						
(i)	el Saldo de Principal Pendiente de la Serie C sea igual o mayor al 2,400% de la suma del Saldo de Principal Pendiente de las Series A1, A2a, A2b, B, C y D		≥ 2,400%	2,484%		S/Y	
(ii)	el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 1,00% del Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios no Dudosos.		≤ 1,00%	1,756%		N	
2.3.3	Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (**)						
(i)	el Saldo de Principal Pendiente de la Serie D sea igual o mayor al 1,108% de la suma del Saldo de Principal Pendiente de las Series A1, A2a, A2b, B, C y D,		≥ 1,108%	3,356%		N	
(ii)	el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 0,75% del Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios no Dudosos.		≤ 0,75%	1,756%		N	

(*) 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 / i)	< 10,00%	16,41%	N