

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

19.10.2020
09.10.2020
20.07.2020
26.05.2006

1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation				Fecha datos	Valor / Importe	Cálculo Ratio	Ratio (valor)
				Data date	Value / Amount	Ratio calculation	Ratio (value)
1.1 Datos: Préstamos Hipotecarios / Data: Mortgage Loans							
a	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios	(b + c + d)	Actual	09.10.2020	205.766.700,97		
Outstanding Balance Mortgage Loans			Currently				
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos)	(>3 y <18 meses)	Actual	09.10.2020	5.153.820,01	% (b / e)	2,573%
Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)			Currently				
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos)	(≤ 3 meses)	Actual	09.10.2020	195.118.876,77		
Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)			Currently				
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos	(≥18 meses)	Actual	09.10.2020	5.494.004,19		
Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans			Currently				
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos	(<18 meses)	Actual	09.10.2020	200.272.696,78	% (e / i)	15,41%
Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans			Currently				
f	Retención para Amortización de las Series A, B, C y D		Actual	19.10.2020	7.489.216,15		
Series A, B, C & D Amortisation Withholding			Currently				
g	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A, B, C y D				7.489.216,15		
Available Funds applied for Amortization of Series A, B, C & D							
h	Déficit de Amortización				0,00		
Amortisation Deficiency							
i	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios		Inicial	26.05.2006	1.300.020.570,99		
Outstanding Balance Mortgage Loans			Initial				
j	Margen medio Ponderado			19.10.2020	0,880258%		
Weighted average margin of Mortgage Loans							
1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue							
A	Saldo Principal Pendiente Serie A		Precedente	20.07.2020	186.221.962,76		
Outstanding Principal Balance Series A			Preceding				
B	Saldo Principal Pendiente Serie B		Precedente	20.07.2020	9.011.208,57	% (B / F)	4,337%
Outstanding Principal Balance Series B			Preceding				
C	Saldo Principal Pendiente Serie C		Precedente	20.07.2020	5.328.741,60	% (C / F)	2,565%
Outstanding Principal Balance Series C			Preceding				
D	Saldo Principal Pendiente Serie D		Precedente	20.07.2020	7.200.000,00	% (D / F)	3,466%
Outstanding Principal Balance Series D			Preceding				
E	Saldo Principal Pendiente Serie E		Precedente	20.07.2020	5.850.000,00		
Outstanding Principal Balance Series E			Preceding				
F	Saldo Principal Pendiente Series A, B, C y D		Precedente	20.07.2020	207.761.912,93		
Outstanding Principal Balance Series A, B, C & D			Preceding				
G	Importe nominal emisión Serie B		Inicial		27.300.000,00		
Issue face amount Series B			Initial				
H	Importe nominal emisión Serie C		Inicial		15.600.000,00		
Issue face amount Series C			Initial				
I	Importe nominal emisión Serie D		Inicial		7.200.000,00		
Issue face amount Series D			Initial				
1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve							
K	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Precedente / Preceding	20.07.2020	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	19.10.2020	5.850.000,00		
o	Fondo de Reserva Dotado		Actual / Current		5.850.000,00		
2 Situación disparadores / Triggers status							
		Fecha datos	Disparador	Condición	Valor Disparador	Actúa S/N	
		Data date	Trigger	Condition	Trigger value	Breach Y/N	
2.1 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						
(i) Déficit de Amortización por importe mayor a la suma			h	> 0,5*B + C + D	17.034.345,89	N	
(ii) del cien por ciento (100%) del importe nominal de emisión de los Bonos de la Serie B y							
(iii) del cien por ciento (100%) del importe nominal de emisión de los Bonos de las Series C y D							
2.1.2	Serie C / Series C						
(i) Déficit de Amortización por importe mayor a la suma			h	> 0,5*C + D	9.864.370,80	N	
(ii) del cien por ciento (50%) del importe nominal de emisión de los Bonos de la Serie C y							
(iii) del cien por ciento (100%) del importe nominal de emisión de los Bonos de la Serie D							
2.1.3	Serie D / Series D						
(i) Déficit de Amortización por importe mayor al cincuenta por ciento (50%) del importe nominal de emisión de los Bonos de la Serie 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%	15,41%	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%	4,337%	S/Y	
(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%	2,573%	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%	2,565%	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%	2,573%	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%	3,466%	S/Y	
(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%	2,573%	N	

NO APLICA POR ESTAR EN EL MÍNIMO

(*) 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%	15,83%	N