

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

19.10.2022
11.10.2022
19.07.2022
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	11.10.2022	147.106.894,44		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <18 meses) Actual Currently	11.10.2022	605.727,57	% (b / e)	0,423%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses) Actual Currently	11.10.2022	142.467.210,25		
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥18 meses) Actual Currently	11.10.2022	4.033.956,62		
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<18 meses) Actual Currently	11.10.2022	143.072.937,82	% (e / i)	11,01%
f	Retención para Amortización de las Series A, B, C y D Series A, B, C & D Amortisation Withholding	Actual Currently	19.10.2022	6.899.014,79		
g	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A, B, C y D Available Funds applied for Amortization of Series A, B, C & D			6.899.014,79		
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		19.10.2022	0,880106%		
1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue						
A	Saldo Principal Pendiente Serie A Outstanding Principal Balance Series A	Precedente Preceding	19.07.2022	138.412.113,48		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B	Precedente Preceding	19.07.2022	6.298.822,53	% (B / F)	4,200%
C	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C	Precedente Preceding	19.07.2022	3.599.327,16	% (C / F)	2,400%
D	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D	Precedente Preceding	19.07.2022	1.661.689,44	% (D / F)	1,108%
E	Saldo Principal Pendiente Serie E Outstanding Principal Balance Series E	Precedente Preceding	19.07.2022	5.850.000,00		
F	Saldo Principal Pendiente Series A, B, C y D Outstanding Principal Balance Series A, B, C & D	Precedente Preceding	19.07.2022	149.971.952,61		
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	19.07.2022	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	19.10.2022	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 pronty of payments						
2.1.1	Serie B / Series B		h	> 0,5*B + C + D	8.410.427,87	N
2.1.2	Serie C / Series C		h	> 0,5*C + D	3.461.353,02	N
2.1.3	Serie D / Series D		h	> 0,5*D	830.844,72	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%	11,01%	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%	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%	0,423%	S/Y
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%	2,400%	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%	0,423%	S/Y
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%	1,108%	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%	0,423%	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 / i)	< 10,00%	11,32%	N