

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

19.07.2023  
12.07.2023  
19.04.2023  
26.05.2006

**1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation**

**1.1 Datos: Préstamos Hipotecarios / Data: Mortgage Loans**

|   |                                                                                                                                                |                                         | Fecha datos<br>Data date | Valor / Importe<br>Value / Amount | Cálculo Ratio<br>Ratio calculation | Ratio (valor)<br>Ratio (value) |
|---|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--------------------------------|
| a | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios<br><i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>                                                                 | (b + c + d)                             | Actual<br>Currently      | 12.07.2023<br>125.926.547,52      |                                    |                                |
| b | Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos)<br><i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>                               | (>3 y <18 meses)<br>(>3 and <18 months) | Actual<br>Currently      | 12.07.2023<br>771.003,18          | % (b / e)                          | 0,623%                         |
| c | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos)<br><i>Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>           | (≤ 3 meses)<br>(≤3 months)              | Actual<br>Currently      | 12.07.2023<br>122.950.489,24      |                                    |                                |
| d | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos<br><i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>                                                | (≥18 meses)<br>(≥18 months)             | Actual<br>Currently      | 12.07.2023<br>2.205.055,10        |                                    |                                |
| e | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos<br><i>Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans</i>                                         | (<18 meses)<br>(<18 months)             | Actual<br>Currently      | 12.07.2023<br>123.721.492,42      | % (e / i)                          | 9,52%                          |
| f | Retención para Amortización de las Series A, B, C y D<br><i>Series A, B, C &amp; D Amortisation Withholding</i>                                |                                         | Actual<br>Currently      | 19.07.2023<br>5.707.221,78        |                                    |                                |
| g | Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A, B, C y D<br><i>Available Funds applied for Amortization of Series A, B, C &amp; D</i> |                                         |                          | 5.707.221,78                      |                                    |                                |
| h | Déficit de Amortización<br><i>Amortisation Deficiency</i>                                                                                      |                                         |                          | 0,00                              |                                    |                                |
| i | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios<br><i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>                                                                 |                                         | Initial<br>Initial       | 26.05.2006<br>1.300.020.570,99    |                                    |                                |
| j | Margen medio Ponderado<br><i>Weighted average margin of Mortgage Loans</i>                                                                     |                                         | 19.07.2023               | 0,879166%                         |                                    |                                |

**1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue**

|   |                                                                                                             |                         |            |                |           |        |
|---|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|------------|----------------|-----------|--------|
| A | Saldo Principal Pendiente Serie A<br><i>Outstanding Principal Balance Series A</i>                          | Precedente<br>Preceding | 19.04.2023 | 118.945.772,68 |           |        |
| B | Saldo Principal Pendiente Serie B<br><i>Outstanding Principal Balance Series B</i>                          | Precedente<br>Preceding | 19.04.2023 | 5.712.033,60   | % (B / F) | 4,413% |
| C | Saldo Principal Pendiente Serie C<br><i>Outstanding Principal Balance Series C</i>                          | Precedente<br>Preceding | 19.04.2023 | 3.264.019,20   | % (C / F) | 2,522% |
| D | Saldo Principal Pendiente Serie D<br><i>Outstanding Principal Balance Series D</i>                          | Precedente<br>Preceding | 19.04.2023 | 1.506.888,72   | % (D / F) | 1,164% |
| E | Saldo Principal Pendiente Serie E<br><i>Outstanding Principal Balance Series E</i>                          | Precedente<br>Preceding | 19.04.2023 | 5.850.000,00   |           |        |
| F | Saldo Principal Pendiente Series A, B, C y D<br><i>Outstanding Principal Balance Series A, B, C &amp; D</i> | Precedente<br>Preceding | 19.04.2023 | 129.428.714,20 |           |        |
| G | Importe nominal emisión Serie B<br><i>Issue face amount Series B</i>                                        | Initial<br>Initial      |            | 27.300.000,00  |           |        |
| H | Importe nominal emisión Serie C<br><i>Issue face amount Series C</i>                                        | Initial<br>Initial      |            | 15.600.000,00  |           |        |
| I | Importe nominal emisión Serie D<br><i>Issue face amount Series D</i>                                        | Initial<br>Initial      |            | 7.200.000,00   |           |        |

**1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve**

|   |                                                    |                        |            |              |
|---|----------------------------------------------------|------------------------|------------|--------------|
| K | Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve | Precedente / Preceding | 19.04.2023 | 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       | 19.07.2023 | 5.850.000,00 |
| o | Fondo de Reserva Dotado                            | Actual / Current       |            | 5.850.000,00 |

**2 Situación disparadores / Triggers status**

| Fecha datos<br>Data date | Disparador<br>Trigger | Condición<br>Condition | Valor Disparador<br>Trigger value | Actúa S/N<br>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 de Amortización por importe mayor a la suma<br>(i) del cincuenta por ciento (50%) del importe nominal de emisión de los Bonos de la Serie B y<br>(ii) del cien por ciento (100%) del importe nominal de emisión de los Bonos de las Series C y D | h | > 0,5*B + C + D | 7.626.924,72 | N |
| 2.1.2 | Serie C / Series C | Déficit de Amortización por importe mayor a la suma<br>(i) del cincuenta por ciento (50%) del importe nominal de emisión de los Bonos de la Serie C y<br>(ii) del cien por ciento (100%) del importe nominal de emisión de los Bonos de la Serie D       | h | > 0,5*C + D     | 3.138.898,32 | N |
| 2.1.3 | Serie D / Series D | 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         | 753.444,36   | 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  |  | N<br>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% | 9,52% |  | N        |

**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% | 4,413% |  | S/Y<br>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%  | 0,623% |  | 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% | 2,522% |  | S/Y<br>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%  | 0,623% |  | 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% | 1,164% |  | S/Y<br>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%  | 0,623% |  | 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<br>Data date | Disparador<br>Trigger | Condición / Condition | Valor Disparador<br>Trigger value | Opción ejercitable<br>S/N<br>Exercisable Option Y/N |
|--------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------|
| 26/05/2006               | % (a / i)             | < 10,00%              | 9,69%                             | S/Y                                                 |