

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

19.01.2024
12.01.2024
19.10.2023
26.05.2006

1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation

1.1 Datos: Préstamos Hipotecarios / Data: Mortgage Loans

			Fecha datos Data date	Valor / Importe Value / Amount	Cálculo Ratio Ratio calculation	Ratio (valor) Ratio (value)
a	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans	(b + c + d)	Actual Currently	12.01.2024 113.803.132,70		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <18 meses) (>3 and <18 months)	Actual Currently	12.01.2024 803.755,94	% (b / e)	0,719%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses) (≤3 months)	Actual Currently	12.01.2024 110.989.755,10		
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥18 meses) (≥18 months)	Actual Currently	12.01.2024 2.009.621,66		
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<18 meses) (<18 months)	Actual Currently	12.01.2024 111.793.511,04	% (e / i)	8,60%
f	Retención para Amortización de las Series A, B, C y D Series A, B, C & D Amortisation Withholding		Actual Currently	19.01.2024 6.356.549,12		
g	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A, B, C y D Available Funds applied for Amortization of Series A, B, C & D			6.356.549,12		
h	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency			0,00		
i	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		Initial Initial	26.05.2006 1.300.020.570,99		
j	Margen medio Ponderado Weighted average margin of Mortgage Loans		19.01.2024	0,880753%		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Serie A Outstanding Principal Balance Series A	Precedente Preceding	19.10.2023	107.667.118,64		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B	Precedente Preceding	19.10.2023	5.712.033,60	% (B / F)	4,835%
C	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C	Precedente Preceding	19.10.2023	3.264.019,20	% (C / F)	2,763%
D	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D	Precedente Preceding	19.10.2023	1.506.888,72	% (D / F)	1,275%
E	Saldo Principal Pendiente Serie E Outstanding Principal Balance Series E	Precedente Preceding	19.10.2023	5.850.000,00		
F	Saldo Principal Pendiente Series A, B, C y D Outstanding Principal Balance Series A, B, C & D	Precedente Preceding	19.10.2023	118.150.060,16		
G	Importe nominal emisión Serie B Issue face amount Series B	Initial Initial		27.300.000,00		
H	Importe nominal emisión Serie C Issue face amount Series C	Initial Initial		15.600.000,00		
I	Importe nominal emisión Serie D Issue face amount Series D	Initial Initial		7.200.000,00		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

K	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Precedente / Preceding	19.10.2023	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	19.01.2024	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	Déficit de Amortización por importe mayor a la suma (i) del cincuenta por ciento (50%) del importe nominal de emisión de los Bonos de la Serie B y (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 (i) del cincuenta por ciento (50%) del importe nominal de emisión de los Bonos de la Serie C y (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 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%	8,60%		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%	4,835%		S/Y 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%	0,719%		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%	2,763%		S/Y 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%	0,719%		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%	1,275%		S/Y 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%	0,719%		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%	8,75%	S/Y