

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
Precedente / Preceding

17.08.2023
09.08.2023
17.05.2023
28.03.2007

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 09.08.2023 223.521.592,87 Currently		
b Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <18 meses) Actual 09.08.2023 1.413.734,02 (>3 and <18 months) Currently	% (b / e)	0,645%
c Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses) Actual 09.08.2023 217.674.203,22 (≤3 months) Currently		
d Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥18 meses) Actual 09.08.2023 4.433.655,63 (≥18 months) Currently		
e Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<18 meses) Actual 09.08.2023 219.087.937,24 (<18 months) Currently	% (e / f)	14,60%
f Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans	Initial 28.03.2007 1.500.118.980,94		
g Retención para Amortización de las Series A, B, C y D Series A, B, C & D Amortization Withholding	(F - e) Actual 17.08.2023 9.679.173,63 Currently		
h Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A, B, C y D Available Funds applied for Amortization of Series A, B, C & D	Actual 17.08.2023 9.679.173,63 Currently		
i Déficit de Amortización Amortisation Deficiency	Actual 17.08.2023 0,00 Currently		
j Saldo Vivo Acumulado de los Préstamos Dudosos Accumulated Outstanding Balance of Doubtful Loans	Actual 09.08.2023 75.546.778,80 Currently		
k Ingresos percibidos por reembolso de principal Income received from repayment of principal	Actual 09.08.2023 11.761.201,35 Currently		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A Saldo Principal Pendiente Serie A Outstanding Principal Balance Series A	Precedente 17.05.2023 207.933.285,00 Preceding		
B Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B	Precedente 17.05.2023 8.937.932,77 Preceding	% (B / F)	3,907%
C Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C	Precedente 17.05.2023 8.693.152,65 Preceding	% (C / F)	3,800%
D Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D	Precedente 17.05.2023 3.202.740,45 Preceding	% (D / F)	1,400%
E Saldo Principal Pendiente Serie E Outstanding Principal Balance Series E	Precedente 17.05.2023 7.500.000,00 Preceding		
F Saldo Principal Pendiente Series A, B, C y D. Outstanding Principal Balance Series A, B, C & D.	Precedente 17.05.2023 228.767.110,87 Preceding		
G Importe nominal emisión Serie A Issue face amount Series A	Initial 28.03.2007 1.431.700.000,00		
H Importe nominal emisión Serie B Issue face amount Series B	Initial 28.03.2007 29.300.000,00		
I Importe nominal emisión Serie C Issue face amount Series C	Initial 28.03.2007 28.500.000,00		
J Importe nominal emisión Serie D Issue face amount Series D	Initial 28.03.2007 10.500.000,00		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

l Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Precedente / Preceding 17.05.2023 7.500.000,00		
m Fondo de Reserva Dotado / Provisioned Cash Reserve	Precedente / Preceding 7.500.000,00		
n Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Actual / Currently 17.08.2023 7.500.000,00		
ñ Fondo de Reserva Dotado / Provisioned Cash Reserve	Actual / Currently 7.500.000,00		

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 Saldo Vivo Ptmos Dudosos	09.08.2023 (i/f)	> 8,00%	5,04%	N
2.1.2 Serie C / Series C Saldo Vivo Ptmos Dudosos	09.08.2023 (j/f)	> 5,20%	5,04%	N
2.1.3 Serie D / Series D Saldo Vivo Ptmos Dudosos	09.08.2023 (j/f)	> 4,50%	5,04%	S/Y

2.2 Fondo de Reserva:

Cash Reserve

NO APLICA POR ESTAR EN EL MÍNIMO

2.3 Amortización a Prorrata Clase A

09.08.2023	(c+k)/A	< 1,00%	1,10	N
------------	---------	---------	------	---

2.4 Amortización a Prorrata Series B, C y D

Pro Rata Amortisation of Series B, C & D

2.4.0 Condiciones comunes / Common conditions ()**

(i) No procede 2.3	09.08.2023	2.3	N		S/Y
(ii) Fondo de Reserva en F.P. = Fondo de Reserva requerido	17.08.2023		= 0,00	0,00	S/Y
(iii) Saldo Vivo Ph's no Dudosos > 10% Aldo Vivo inicial	09.08.2023		≥ 10,00%	14,60%	S/Y

2.4.1 Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions ()**

(i) el Saldo de Principal Pendiente de la Serie B sea igual o mayor al 3,907%	09.08.2023		≥ 3,907%	3,907%	S/Y
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,25%	09.08.2023		≤ 1,25%	0,645%	S/Y

2.4.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions ()**

(i) el Saldo de Principal Pendiente de la Serie C sea igual o mayor al 3,800%	09.08.2023		≥ 3,800%	3,800%	S/Y
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,00%	09.08.2023		≤ 1,00%	0,645%	S/Y

2.4.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions ()**

(i) el Saldo de Principal Pendiente de la Serie D sea igual o mayor al 1,400% de la suma del	09.08.2023		≥ 1,400%	1,400%	S/Y
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 0,75%	09.08.2023		≤ 0,75%	0,645%	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
28/03/2007	% (a / g)	< 10,00%	14,90%	N