

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
 19.08.2024
 09.08.2024
 17.05.2024
 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 09.08.2024	187.831.711,96		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <18 meses) (>3 and <18 months)	Actual 09.08.2024	1.998.605,61	% (b / e)	1,088%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses) (≤3 months)	Actual 09.08.2024	181.770.060,42		
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥18 meses) (≥18 months)	Actual 09.08.2024	4.063.045,93		
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<18 meses) (<18 months)	Actual 09.08.2024	183.768.666,03	% (e / f)	12,25%
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 Amortisation Withholding	(F - e)	Actual 19.08.2024	8.770.857,56		
h	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A, B, C y D Available Funds applied for Amortization of Series A, B, C & D		Actual 19.08.2024	8.770.857,56		
i	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency		Actual 19.08.2024	0,00		
j	Saldo Vivo Acumulado de los Préstamos Dudosos Accumulated Outstanding Balance of Doubtful Loans		Actual 09.08.2024	76.007.696,98		
k	Ingresos percibidos por reembolso de principal Income received from repayment of principal		Actual 09.08.2024	8.732.488,63		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Serie A Outstanding Principal Balance Series A		Precedente 17.05.2024	174.756.792,00		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B		Precedente 17.05.2024	7.522.520,09	% (B / F)	3,907%
C	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C		Precedente 17.05.2024	7.316.502,90	% (C / F)	3,800%
D	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D		Precedente 17.05.2024	2.943.708,60	% (D / F)	1,529%
E	Saldo Principal Pendiente Serie E Outstanding Principal Balance Series E		Precedente 17.05.2024	7.500.000,00		
F	Saldo Principal Pendiente Series A, B, C y D. Outstanding Principal Balance Series A, B, C & D.		Precedente 17.05.2024	192.539.523,59		
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	17.05.2024	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	19.08.2024	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	09.08.2024	(j/f)	> 8,00%	5,07%	N
2.1.2 Serie C / Series C	Saldo Vivo Ptmos Dudosos	09.08.2024	(j/f)	> 5,20%	5,07%	N
2.1.3 Serie D / Series D	Saldo Vivo Ptmos Dudosos	09.08.2024	(j/f)	> 4,50%	5,07%	S/Y

2.2 Fondo de Reserva:

Cash Reserve

NO APLICA POR ESTAR EN EL MÍNIMO

2.3 Amortización a Prorrata Series B, C y D

Pro Rate Amortisation of Series B, C & D

2.3.0 Condiciones comunes / Common conditions (**)						S/Y
(i) No procede 2.3	09.08.2024	2.3	N			S/Y
(ii) Fondo de Reserva en F.P. = Fondo de Reserva requerido	19.08.2024		= 0,00	0,00		S/Y
(iii) Saldo Vivo Ph's no Dudosos > 10% Aldo Vivo inicial	09.08.2024		≥ 10,00%	12,25%		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 3,907%	09.08.2024		≥ 3,907%	3,907%		S/Y
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,25%	09.08.2024		≤ 1,25%	1,088%		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 3,800%	09.08.2024		≥ 3,800%	3,800%		N
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,00%	09.08.2024		≤ 1,00%	1,088%		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 1,400% de la suma del	09.08.2024		≥ 1,400%	1,529%		N
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 0,75%	09.08.2024		≤ 0,75%	1,088%		N

(*) 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%	12,52%	N