

Fecha de Pago / Payment Date	Actual / Current	17.01.2024
Fecha de Determinación / Determination Date	Actual / Current	11.01.2024
Fecha de Pago / Payment Date	Precedente / Preceding	17.10.2023
Fecha constitución Fondo / Fund establishment date		20.11.2006

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 Current		230.855.214,45 %	14,90%
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <18 meses)	11.01.2024	Actual Current		833.108,64 %	0,368%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Do)	(≤ 3 meses)	11.01.2024	Actual Current		225.355.454,30 %	
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥ 18 meses)	11.01.2024	Actual Current		4.666.651,51 %	
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<18 meses)	11.01.2024	Actual Current		226.188.562,94 %	14,60%
f	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		20.11.2006	Initial		1.549.431.516,52	
g	Margen medio ponderado de Préstamos Hipotecarios Weighted average margin of Mortgage Loans		11.01.2024	Actual Current		0,505671%	
h	Retención para Amortización de las Series A1, A2, B, C y D Series A1, A2, B, C & D Amortisation Withholding		11.01.2024	Actual Current	F - e	14.121.959,95	
i	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A1, A2, B, C y D Available Funds applied for Amortization of Series A1, A2, B, C & D.		11.01.2024	Actual Current		14.121.959,95	
j	Déficit de Amortización Amortisation Deficiency		11.01.2024	Actual Current	h - i	0,00	

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase A Outstanding Principal Balance Class A		17.10.2023	Precedente Preceding		219.528.465,72	
A1	Saldo Principal Pendiente Serie A1 Outstanding Principal Balance Series A1		17.10.2023	Precedente Preceding		0,00	
A2	Saldo Principal Pendiente Serie A2 Outstanding Principal Balance Series A2		17.10.2023	Precedente Preceding		219.528.465,72	
B	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B		17.10.2023	Precedente Preceding	(B / F)	6.947.377,92	2,891%
C	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C		17.10.2023	Precedente Preceding	(C / F)	7.476.061,00	3,111%
D	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D		17.10.2023	Precedente Preceding	(D / F)	6.358.618,25	2,646%
E	Saldo Principal Pendiente Serie E Outstanding Principal Balance Series E		17.10.2023	Precedente Preceding		10.349.627,46	
F	Saldo Principal Pendiente Series A1, A2, B, C y D Outstanding Principal Balance Series A1, A2, B, C and D		17.10.2023	Precedente Preceding		240.310.522,89	

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		17.10.2023	Precedente / Preceding		10.300.000,00	
n	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve		17.10.2023	Precedente / Preceding	(n - m)	10.300.000,00	0,00
o	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		17.01.2024	Actual / Current		10.300.000,00	
p	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve		17.01.2024	Actual / Current	(p - o)	10.300.000,00	0,00

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 Amortización a Prorrata Clase A / Pro Rata Amortisation Class A

NO PROCEDE

2.2 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

2.2.1 Serie B / Series B	11.01.2024	i	> 98% * (B + C + D)	20.366.416,03	N
2.2.2 Serie C / Series C	11.01.2024	j	> 81% * (C + D)	11.206.090,19	N
2.2.3 Serie D / Series D	11.01.2024	i	> 69% * D	4.387.446,59	N

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)	17.01.2024	(p - o)	= 0,00	0,00	S/Y
(ii)	11.01.2024	% (a / f)	≥ 10,00%	14,90%	S/Y

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

(i)	11.01.2024	% (B / F)	≥ 2,891%	2,891%	S/Y
(ii)	11.01.2024	% (b / e)	≤ 1,50%	0,368%	S/Y

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

(i)	11.01.2024	% (C / F)	≥ 3,111%	3,111%	S/Y
(ii)	11.01.2024	% (b / e)	≤ 1,25%	0,368%	S/Y

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

(i)	11.01.2024	% (D / F)	≥ 2,646%	2,646%	S/Y
(ii)	11.01.2024	% (b / e)	≤ 0,75%	0,368%	S/Y

2.4 Reducción Fondo Reserva Requerido: condiciones ()**

NO PROCEDE POR ESTAR EN EL MINIMO

Required Cash Reserve reduction: conditions

(*) Deben darse todas las condiciones / All conditions must concur

(**) No procede reducción si se da alguna de las condiciones / Do not proceed reduction if any condition concurs

3 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
11.01.2024	% (a / f)	< 10,00%	14,90%	N