

Fecha de Pago / Payment Date
Fecha de Determinación / Determination Date
Fecha de Pago / Payment Date
Fecha constitución Fondo / Fund establishment date

Actual / Current **26.06.2023**
 Actual / Current **20.06.2023**
 Precedente / Preceding **27.03.2023**
 Precedente / Preceding **02.02.2006**

1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation

| | | | Fecha datos Data date | Valor / Importe Value / Amount | Cálculo Ratio Ratio calculation | Ratio (valor) Ratio (value) |
|--|------------------|--------------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--------------------------------|
| 1.1 Datos: Préstamos Hipotecarios / Data: Mortgage Loans | | | | | | |
| a Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans | (b + c + d) | Actual Current | | 268.248.997,83 | | |
| b Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful) | (>3 y <18 meses) | Actual Current | 20.06.2023 | 2.956.390,60 | % (b / e) | 1,188% |
| c Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful) | (≤ 3 meses) | Actual Current | 20.06.2023 | 245.856.366,36 | | |
| d Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans | (≥18 meses) | Actual Current | 20.06.2023 | 19.436.240,87 | | |
| e Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans | (<18 meses) | Actual Current | 20.06.2023 | 248.812.756,96 | % (e / g) | 12,44% |
| f Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans | | Inicial Initial | 02.02.2006 | 2.000.095.452,90 | | |
| g Margen medio ponderado de Préstamos Hipotecarios Weighted average margin of Mortgage Credits | | Actual Current | 20.06.2023 | 0,909640% | | |
| h Retención para Amortización de las Series A1, A2, B, C y D Series A1, A2, B, C & D Amortisation Withholding | | Actual Current | 20.06.2023 | 10.711.673,04 | F - e | |
| 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. | | Actual Current | 20.06.2023 | 10.711.673,04 | | |
| j Déficit de Amortización Amortisation Deficiency | | Actual Current | 26.06.2023 | 0,00 | h - i | |

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

| | | | | | | |
|--|--|------------------------|------------|----------------|-----------|---------|
| A Saldo Principal Pendiente Clase A Outstanding Principal Balance Class A | | Precedente / Preceding | 27.03.2023 | 159.524.430,00 | | |
| A1 Saldo Principal Pendiente Serie A1 Outstanding Principal Balance Series A1 | | Precedente / Preceding | 27.03.2023 | 0,00 | | |
| A2 Saldo Principal Pendiente Serie A2 Outstanding Principal Balance Series A2 | | Precedente / Preceding | 27.03.2023 | 159.524.430,00 | | |
| B Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B | | Precedente / Preceding | 27.03.2023 | 52.000.000,00 | % (B / F) | 20,037% |
| C Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C | | Precedente / Preceding | 27.03.2023 | 25.000.000,00 | % (C / F) | 9,633% |
| D Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D | | Precedente / Preceding | 27.03.2023 | 23.000.000,00 | % (D / F) | 8,862% |
| E Saldo Principal Pendiente Serie E Outstanding Principal Balance Series E | | Precedente / Preceding | 27.03.2023 | 22.600.000,00 | | |
| F Saldo Principal Pendiente Series A1, A2, B, C y D Outstanding Principal Balance Series A1, A2, B, C and D | | Precedente / Preceding | 27.03.2023 | 259.524.430,00 | | |

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

| | | | | | | |
|--|--|------------------------|------------|---------------|---------|---------------|
| k Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve | | Precedente / Preceding | 27.03.2023 | 22.600.000,00 | | |
| l Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve | | Precedente / Preceding | 27.03.2023 | 19.054.630,87 | (l - k) | -3.545.369,13 |
| m Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve | | Actual / Current | 26.06.2023 | 22.600.000,00 | | |
| n Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve | | Actual / Current | 26.06.2023 | 20.821.549,47 | (n - m) | -1.778.450,53 |

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 | 26.06.2023 | j | > (85% * B) + C + D | 92.200.000,00 | N |
| 2.1.2 Serie C / Series C | 26.06.2023 | j | > (85% * C) + D | 44.250.000,00 | N |
| 2.1.3 Serie D / Series D | 26.06.2023 | j | > 85% * D | 19.550.000,00 | N |
| 2.2 Amortización a Prorrata Series B, C y D Pro Rata Amortisation of Series B, C & D | | | | | |
| 2.2.0 Condiciones comunes / Common conditions (*) | | | | | |
| (i) Fondo Reserva Requerido = Fondo Reserva Dotado | 26.06.2023 | (n - m) | = 0,00 | -1.778.450,53 | N |
| (ii) Saldo vivo ≥ 10% Saldo Inicial Fondo | 26.06.2023 | % (a / f) | ≥ 10,00% | 13,41% | S/Y |
| 2.2.1 Serie B: condiciones particulares / Series B: particular conditions (*) | | | | | |
| (i) Serie B ≥ 5,20% de Saldo Series A1, A2, B, C y D | 20.06.2023 | % (B / F) | ≥ 5,200% | 20,037% | S/Y |
| (ii) Saldo vivo Morosos ≤ 1,25% de Saldo vivo no dudosos | 20.06.2023 | % (b / e) | ≤ 1,25% | 1,188% | S/Y |
| 2.2.2 Serie C: condiciones particulares / Series C: particular conditions (*) | | | | | |
| (i) Serie C ≥ 2,50% de Saldo Series A1, A2, B, C y D | 20.06.2023 | % (C / F) | ≥ 2,500% | 9,633% | S/Y |
| (ii) Saldo vivo Morosos ≤ 1,00% de Saldo vivo no dudosos | 20.06.2023 | % (b / e) | ≤ 1,00% | 1,188% | N |
| 2.2.3 Serie D: condiciones particulares / Series D: particular conditions (*) | | | | | |
| (i) Serie D ≥ 2,30% de Saldo Series A1, A2, B, C y D | 20.06.2023 | % (D / F) | ≥ 2,300% | 8,862% | S/Y |
| (ii) Saldo vivo Morosos ≤ 0,75% de Saldo vivo no dudosos | 20.06.2023 | % (b / e) | ≤ 0,75% | 1,188% | N |
| 2.3 Fondo de Reserva; Cash Reserve: | | | | | |
| 2.3.1 Condiciones de reducción: Conditions Cash Reserve reduction: | 26.06.2023 | % m/(F-(F-e)) | > 2,26% | 9,083% | S/Y |
| 2.3.2 Condiciones de no reducción (solo aplica si 2.4.1 es S/Y) (**) Conditions Cash Reserve reduction (only applicable if 2.4.1 is S/Y)(**) | | | | | |
| (i) Saldo Vivo Morosos > 1% Saldo Vivo no Dudosos | 20.06.2023 | % (b / e) | > 1,00% | 1,188% | S/Y |
| (ii) No se pudiera dotar el Fondo Reserva Requerido en FP anterior | 27.03.2023 | (l - k) | < 0,00 | -3.545.369,13 | S/Y |
| (iii) Margen medio Indices Ref por Ppal Pte ≤ 0,60% | 20.06.2023 | g | ≤ 0,600% | 0,910% | N |
| (iv) No hayan pasado 3 años desde Constitución Fondo | 26.06.2023 | 02.02.2006 | años/years < 3,00 | 17,41 | N |

(*) 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 |
|--------------------------|-----------------------|------------------------|-----------------------------------|--|
| 20.06.2023 | % (a / g) | < 10,00% | 13,41% | N |