

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

Actual / Current **20.06.2024**
 Actual / Current **13.06.2024**
 Precedente / Preceding **20.03.2024**
19.06.2009

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 <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>	(b + c + d)	Actual Current	7.873.820,72		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans</i>	(>3 y <12 meses) (>3 y <12 meses)	Actual Current	13.06.2024 62.449,57	% (b / (a - d))	0,799%
c	Préstamo fallidos <i>Failed Loans</i>		Actual Current	13.06.2024 82.236,84	% ((c+d) / (a-d))	1,849%
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	(≥12 meses) (≥12 months)	Actual Current	13.06.2024 62.215,57		
e	Retención para Amortización de las Series AG, B(CA), C(CA) <i>Series AG, B(CA), C(CA) Amortisation Withholding</i>		Actual Current	13.06.2024 1.309.552,44		
f	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CA), C(CA) <i>Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CA), C(CA)</i>		Actual Current	13.06.2024 1.309.552,44		
g	Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i>		Actual Current	20.06.2024 0,00		
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>		Initial Initial	19.06.2009 277.017.643,68		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase AG <i>Outstanding Principal Balance Class A</i>		Precedente Preceding	20.03.2024 0,00		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CA) <i>Outstanding Principal Balance Series B(CA)</i>		Precedente Preceding	20.03.2024 5.921.158,04		
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CA) <i>Outstanding Principal Balance Series C(CA)</i>		Precedente Preceding	20.03.2024 3.200.000,00		
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CA) <i>Outstanding Principal Balance Series D(CA)</i>		Precedente Preceding	20.03.2024 3.168.108,20		
E	Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CA) y C (CA) <i>Outstanding Principal Balance Series AG, B (CA), C(CA)</i>		Precedente Preceding	20.03.2024 9.121.158,04		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido CA <i>Required Cash Reserve CA</i>		Precedente Preceding	20.03.2024 3.050.000,00		
n	Fondo de Reserva dotado CA <i>Provisioned Cash Reserve CA</i>		Precedente Preceding	20.03.2024 3.050.000,00	(n - m)	0,00
o	Fondo de Reserva Requendo CA / Required Cash Reserve CA		Actual / Currently Actual / Currently	20.06.2024 3.050.000,00		
p	Fondo de Reserva dotado CA / Provisioned Cash Reserve CA		Actual / Currently Actual / Currently	20.06.2024 3.050.000,00	(p - o)	0,00

2 Situación disparadores / Triggers status
2.2 Pago intereses Series B y C: postergación lugar orden de prelación

Interest payment of Series B & C: place deferred in priority of payments

	Fecha datos Data date	Disparador Trigger	Condición Condition	Valor Disparador Trigger value	Actúa S/N Breach Y/N
2.2.1 Serie B / Series B	20.06.2024	g	> (50% * B) + C	6.160.579,02	N
2.2.2 Serie C / Series C	20.06.2024	g	> (50% * C)	1.600.000,00	N

2.3 Fondo de Reserva:

Cash Reserve:

2.3.1 Condiciones de no reducción

*Conditions Cash Reserve reduction(**)*

NO PROCEDE POR ESTAR EN EL MINIMO

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
	13.06.2024	% ((a-d) / h)	< 10,00%	2,82%	SY

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

(*) Condición Global de todos los cedentes.

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

Actual / Current **20.06.2024**
 Actual / Current **13.06.2024**
 Precedente / Preceding **20.03.2024**
19.06.2009

1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation
1.1 Datos: Préstamos Hipotecarios / Data: Mortgage Loans

a	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios	(b + c + d)	Actual
	<i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>		Current
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos	(>3 y <12 meses)	Actual
	<i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans</i>	(>3 y <12 meses)	Current
c	Préstamo fallidos		Actual
	<i>Failed Loans</i>		Current
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos	(≥12 meses)	Actual
	<i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	(≥12 months)	Current
e	Retención para Amortización de las Series AG, B(CM), C(CM)		Actual
	<i>Series AG, B(CM), C(CM) Amortisation Withholding</i>		Current
f	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CM), C(CM)		Actual
	<i>Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CM), C(CM)</i>		Current
g	Déficit de Amortización		Actual
	<i>Amortisation Deficiency</i>		Current
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios		Initial
	<i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>		Initial

Fecha datos	Valor / Importe	Cálculo Ratio	Ratio (valor)
Data date	Value / Amount	Ratio calculation	Ratio (value)
	2.707.435,08		
13.06.2024	5.124,91	% (b / (a - d))	0,190%
13.06.2024	104.297,87	% ((c+d) / (a-d))	4,230%
13.06.2024	9.804,88		
13.06.2024	335.286,60		
13.06.2024	335.286,60		
20.06.2024	0,00		
19.06.2009	74.458.609,46		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase AG		Precedente
	<i>Outstanding Principal Balance Class A</i>		Preceding
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CM)		Precedente
	<i>Outstanding Principal Balance Series B(CM)</i>		Preceding
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CM)		Precedente
	<i>Outstanding Principal Balance Series C(CM)</i>		Preceding
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CM)		Precedente
	<i>Outstanding Principal Balance Series D(CM)</i>		Preceding
E	Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CM) y C (CM)		Precedente
	<i>Outstanding Principal Balance Series AG, B (CM), C(CM)</i>		Preceding

20.03.2024	0,00		
20.03.2024	732.916,80		
20.03.2024	2.300.000,00		
20.03.2024	2.173.162,25		
20.03.2024	3.032.916,80		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido CM		Precedente
	<i>Required Cash Reserve CM</i>		Preceding
n	Fondo de Reserva dotado CM		Precedente
	<i>Provisioned Cash Reserve CM</i>		Preceding
o	Fondo de Reserva Requerido CM / Required Cash Reserve CM		Actual / Current
	<i>Required Cash Reserve CM</i>		Actual / Current
p	Fondo de Reserva dotado CM / Provisioned Cash Reserve CM		Actual / Current
	<i>Provisioned Cash Reserve CM</i>		Actual / Current

20.03.2024	1.922.166,70		
20.03.2024	1.922.166,70	(n - m)	0,00
20.06.2024	1.922.166,70		
20.06.2024	1.922.166,70	(p - o)	0,00

2 Situación disparadores / Triggers status

Fecha datos	Disparador	Condición	Valor Disparador	Actúa S/N
Data date	Trigger	Condition	Trigger value	Breach Y/N

2.2 Pago intereses Series B y C: postergación lugar orden de prelación

Interest payment of Series B & C: place deferred in priority of payments

2.2.1 Serie B / Series B

20.06.2024 g > (50% * B) + C 2.666.458,40 N

2.2.2 Serie C / Series C

20.06.2024 q > (50% * C) 1.150.000,00 N

2.3 Fondo de Reserva:

Cash Reserve:

2.3.1 Condiciones de no reducción

*Conditions Cash Reserve reduction(**)*

- (i) No hayan pasado 3 años desde Constitución Fondo
- (ii) No Nivel Mínimo TODOS Fondos Reserva Fecha Pago anterior *
- (iii) Saldo Vivo Morosos > 1% del Saldo Vivo no Fallidos
- (iv) Prestamos fallidos > 1% del Saldo Vivo no Fallidos

20.06.2024	19.06.2009	años/years < 3.00	15,01	N
20.03.2024	(n - m)	< 0,00	0,00	N
13.06.2024	% (b / (a - d))	≥ 1,00%	0,190%	N
13.06.2024	% ((c+d) / (a-d))	≥ 1,00%	4,230%	S/Y

3 Amortización Anticipada opcional / Optional Early Amortization

Fecha datos	Disparador	Condición /Condition	Valor Disparador	Opción Ejercitable S/N
Data date	Trigger	Condition /Condition	Trigger value	Exercisable Option Y/N
13.06.2024	% (a-d) / h)	< 10,00%	3,62%	S/Y

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

(*) Condición Global de todos los cedentes.

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

Actual / Current **20.06.2024**
 Actual / Current **13.06.2024**
 Precedente / Preceding **20.03.2024**
19.06.2009

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 <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>	(b + c + d)		779.922,34		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans</i>	(>3 y <12 meses) (>3 y <12 meses)	13.06.2024	0,00	% (b / (a - d))	0,000%
c	Préstamo fallidos <i>Failed Loans</i>		13.06.2024	17.466,76	% ((c+d) / (a-d))	9,049%
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	(≥12 meses) (≥12 months)	13.06.2024	48.699,73		
e	Retención para Amortización de las Series AG, B(CT), C(CT) <i>Series AG, B(CT), C(CT) Amortisation Withholding</i>		13.06.2024	98.556,75		
f	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CT), C(CT) <i>Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CT), C(CT)</i>		13.06.2024	98.556,75		
g	Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i>		20.06.2024	0,00		
h	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>		19.06.2009	47.531.480,66		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Clase AG <i>Outstanding Principal Balance Class A</i>		Precedente 20.03.2024	0,00		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B (CT) <i>Outstanding Principal Balance Series B(CT)</i>		Precedente 20.03.2024	0,00		
C	Saldo Principal Pendiente Serie C (CT) <i>Outstanding Principal Balance Series C(CT)</i>		Precedente 20.03.2024	829.779,45		
D	Saldo Principal Pendiente Serie D (CT) <i>Outstanding Principal Balance Series D(CT)</i>		Precedente 20.03.2024	1.020.809,44		
E	Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CT) y C (CT) <i>Outstanding Principal Balance Series AG, B (CT), C(CT)</i>		Precedente 20.03.2024	829.779,45		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m	Fondo de Reserva Requerido CT <i>Required Cash Reserve CT</i>		Precedente 20.03.2024	700.000,00		
n	Fondo de Reserva dotado CT <i>Provisioned Cash Reserve CT</i>		Precedente 20.03.2024	700.000,00	(n - m)	0,00
o	Fondo de Reserva Requerido CT / <i>Required Cash Reserve CT</i>		Actual / Currently 20.06.2024	700.000,00		
p	Fondo de Reserva dotado CT / <i>Provisioned Cash Reserve CT</i>		Actual / Currently 20.06.2024	700.000,00	(p - o)	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
--------------------------	-----------------------	------------------------	-----------------------------------	-------------------------

2.2 Pago intereses Series B y C: postergación lugar orden de prelación

Interest payment of Series B & C: place deferred in priority of payments

2.2.1 Serie B / Series B

20.06.2024 g > (50% * B) + C 829.779,45 N

2.2.2 Serie C / Series C

20.06.2024 g > (50% * C) 414.889,73 N

2.3 Fondo de Reserva:

Cash Reserve:

2.3.1 Condiciones de no reducción

*Conditions Cash Reserve reduction(**)*

NO PROCEDE POR ESTAR EN EL MINIMO

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
13.06.2024	% ((a-d) / h)	< 10,00%	1,54%	S/Y

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

(*) Condición Global de todos los cedentes.

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

Actual / Current 20.06.2024
 Actual / Current 13.06.2024
 Precedente / Preceding 20.03.2024
 19.06.2009

1 Datos para cálculo de disparadores / Data for Triggers calculation

1.1 Datos: Préstamos Hipotecarios / Data: Mortgage Loans

Fecha datos	Valor / Importe	Cálculo Ratio	Ratio (valor)
Data date	Value / Amount	Ratio calculation	Ratio (value)
a Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>	(b + c + d) Actual 528.858,07		
b Saldo Vivo Préstamos Morosos <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans</i>	(>3 y <12 meses) Actual 13.06.2024 6.407,66	% (b / (a - d))	1,256%
c Préstamo fallidos <i>Failed Loans</i>	(>3 y <12 meses) Actual 13.06.2024 28.949,22	% ((c+d) / (a-d))	9,321%
d Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	(≥12 meses) Actual 13.06.2024 18.610,77		
e Retención para Amortización de las Series AG, B(CP), C(CP) <i>Series AG, B(CP), C(CP) Amortisation Withholding</i>	Actual 13.06.2024 83.388,15		
f Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series AG B(CP), C(CP) <i>Available Funds applied for Amortization of Series AG, B(CP), C(CP)</i>	Actual 13.06.2024 83.388,15		
g Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i>	Actual 20.06.2024 0,00		
h Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>	19.06.2009 Inicial 55.764.028,90		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A Saldo Principal Pendiente Clase AG <i>Outstanding Principal Balance Class A</i>	Precedente 20.03.2024 0,00		
B Saldo Principal Pendiente Serie B (CP) <i>Outstanding Principal Balance Series B(CP)</i>	Precedente 20.03.2024 0,00		
C Saldo Principal Pendiente Serie C (CP) <i>Outstanding Principal Balance Series C(CP)</i>	Precedente 20.03.2024 593.635,50		
D Saldo Principal Pendiente Serie D (CP) <i>Outstanding Principal Balance Series D(CP)</i>	Precedente 20.03.2024 899.208,16		
E Saldo Principal Pendiente Series AG, B (CP) y C (CP) <i>Outstanding Principal Balance Series AG, B (CP), C(CP)</i>	Precedente 20.03.2024 593.635,50		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

m Fondo de Reserva Requerido CP <i>Required Cash Reserve CP</i>	Precedente 20.03.2024 800.000,00		
n Fondo de Reserva dotado CP <i>Provisioned Cash Reserve CP</i>	Precedente 20.03.2024 800.000,00	(n - m)	0,00
o Fondo de Reserva Requerido CP / Required Cash Reserve CP	Actual / Currently 20.06.2024 800.000,00		
p Fondo de Reserva dotado CP / Provisioned Cash Reserve CP	Actual / Currently 20.06.2024 800.000,00	(p - o)	0,00

2 Situación disparadores / Triggers status

Fecha datos	Disparador	Condición	Valor Disparador	Actúa S/N
Data date	Trigger	Condition	Trigger value	Breach Y/N
20.06.2024	g	> (50% * B) + C	593.635,50	N
20.06.2024	g	> (50% * C)	296.817,75	N

2.2 Pago intereses Series B y C: postergación lugar orden de prelación

Interest payment of Series B & C: place deferred in priority of payments

2.2.1 Serie B / Series B

2.2.2 Serie C / Series C

2.3 Fondo de Reserva:

Cash Reserve:

2.3.1 Condiciones de no reducción

*Conditions Cash Reserve reduction(**)*

NO PROCEDE POR ESTAR EN EL MINIMO

3 Amortización Anticipada opcional / Optional Early Amortization

Fecha datos	Disparador	Condición /Condition	Valor Disparador	Opción Ejercitable S/N
Data date	Trigger	Condition /Condition	Trigger value	Exercisable Option Y/N
13.06.2024	% ((a-d) / h)	< 10,00%	0,92%	S/Y

(**) No procede reducción si se da alguna de las condiciones / Do not proceed reduction if any condition concurs
 (*) Condición Global de todos los cedentes.