

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

Actual / Current **26.03.2024**  
 Actual / Current **20.03.2024**  
 Precedente / Preceding **27.12.2023**  
**03.04.2006**

**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 Currently		66.838.928,35		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)	(>3 y <18 meses) (>3 and <18 months)	Actual Currently	20.03.2024	865.445,85	% (b / e)	1,418%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Credits (Non-Doubtful)	(≤ 3 meses) (≤3 months)	Actual Currently	20.03.2024	60.182.945,58		
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans	(≥18 meses) (≥18 months)	Actual Currently	20.03.2024	5.790.536,92		
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans	(<18 meses) (<18 months)	Actual Currently	20.03.2024	61.048.391,43	% (e / g)	7,63%
f	Déficit de Amortización Amortization Deficiency		Actual Currently	20.03.2024	0,00	i - j	
q	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Outstanding Balance Mortgage Loans		Inicial Initial	03.04.2006	800.012.981,57		
i	Retención para amortización Amortisation withholding		Actual Currently	26.03.2024	3.525.049,61	F - e	
j	Fondos Disponibles para amortización Available Funds for amortisation		Actual Currently	26.03.2024	3.525.049,61		

**1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue**

A	Saldo Principal Pendiente Clase A Outstanding Principal Balance Class A		Precedente Preceding	27.12.2023	51.902.197,20		
A1	Saldo Principal Pendiente Serie A1 Outstanding Principal Balance Series A1		Precedente Preceding	27.12.2023	0,00		
A2	Saldo Principal Pendiente Serie A2 Outstanding Principal Balance Series A2		Precedente Preceding	27.12.2023	51.902.197,20		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B Outstanding Principal Balance Series B		Precedente Preceding	27.12.2023	2.651.249,04	% (B / F)	4,106%
C	Saldo Principal Pendiente Serie C Outstanding Principal Balance Series C		Precedente Preceding	27.12.2023	2.819.994,80	% (C / F)	4,367%
D	Saldo Principal Pendiente Serie D Outstanding Principal Balance Series D		Precedente Preceding	27.12.2023	7.200.000,00	% (D / F)	11,150%
E	Saldo Principal Pendiente Serie E Outstanding Principal Balance Series E		Precedente Preceding	27.12.2023	10.000.000,00		
F	Saldo Principal Pendiente Series A1, A2, B, C y D Outstanding Principal Balance Series A1, A2, B, C and D		Precedente Preceding	27.12.2023	64.573.441,04		
G	Importe Nominal Emisión de Series A1, A2, B, C y D Issue face amount of Series A1, A2, B, C and D		Inicial Initial	03.04.2006	800.000.000,00		

**1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve**

l	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Precedente / Preceding	27.12.2023	10.000.000,00		
m	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve		Precedente / Preceding	27.12.2023	10.000.000,00	(m - l)	0,00
n	Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve		Actual / Currently	26.03.2024	10.000.000,00		
o	Fondo de Reserva dotado / Provisioned Cash Reserve		Actual / Currently	26.03.2024	10.000.000,00	(o - n)	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 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	20.03.2024	f	> (0,85*B)+(C+D)	12.273.556,48	N
2.1.2 Serie C / Series C	20.03.2024	f	> (0,85*C)+ D	9.596.995,58	N
2.1.3 Serie D / Series D	20.03.2024	f	> 0,85*D	6.120.000,00	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) Dotación Fondo Reserva	27.12.2023	(m - l)	= 0,00	0,00	N
(ii) SV no dudoso sobre Saldo inicial constitucion	20.03.2024	% (e / g)	≥ 10,00%	7,63%	S/Y

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

(i) % Serie B sobre total bonos	20.03.2024	% (B / F)	≥ 3,300%	4,106%	S/Y
(ii) Morosos / SV no dudoso	20.03.2024	% (b / e)	≤ 1,50%	1,418%	S/Y

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

(i) % Serie C sobre total bonos	20.03.2024	% (C / F)	≥ 2,900%	4,367%	S/Y
(ii) Morosos / SV no dudoso	20.03.2024	% (b / e)	≤ 1,25%	1,418%	N

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

(i) % Serie D sobre total bonos	20.03.2024	% (D / F)	≥ 1,800%	11,150%	S/Y
(ii) Morosos / SV no dudoso	20.03.2024	% (b / e)	≤ 1,00%	1,418%	N

**2.3 Fondo de Reserva:**  
*Cash Reserve*
**2.3.1 Condiciones de reduccion**  
*Cash Reserve reduction:*

	26.03.2024	% G- (G-e)	> 2,50%	16,38%	S/Y
--	------------	------------	---------	--------	-----

**2.3.2 Condiciones de no reduccion (solo aplica si 2.3.1 es S/Y) (\*\*)**  
*Cash Reserve no reduction (\*\*)*

(i) Morosos / Saldo Vivo no dudoso	20.03.2024	% (b / e)	> 1,00%	1,418%	S/Y
(ii) No se pudiera dotar el Fondo Reserva Requerido en FP anterior	27.12.2023	(m - l)	< 0,00	0,00	N
(iii) Margen medio Indices Ref por Ppal Pte ≤ 0,60%	20.03.2024	g	≤ 0,600%	0,931723%	N
(iv) No hayan pasado 3 años desde Constitucion Fondo	26.03.2024	03.04.2006	años/years < 3,00	17,99	N

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

(\*\*) No procede reduccion 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 Exercitable option Y/N
--------------------------	-----------------------	------------------------	-----------------------------------	--

20.03.2024	% (a / g)	< 10,00%	8,35%	S/Y
------------	-----------	----------	-------	-----