

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

Actual / Current 19.04.2024
 Actual / Current 12.04.2024
 Precedente / Preceding 19.01.2024
 Inicial 26.05.2006

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 <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i> | (b + c + d) | Actual 12.04.2024 | 108.250.028,75 | | |
| b | Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i> | (>3 y <18 meses) (>3 and <18 months) | Actual 12.04.2024 | 901.643,58 | % (b / e) | 0,848% |
| c | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i> | (≤ 3 meses) (≤3 months) | Actual 12.04.2024 | 105.456.722,43 | | |
| d | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i> | (≥18 meses) (≥18 months) | Actual 12.04.2024 | 1.891.662,74 | | |
| e | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos <i>Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans</i> | (<18 meses) (<18 months) | Actual 12.04.2024 | 106.358.366,01 | % (e / i) | 8,18% |
| f | Retención para Amortización de las Series A, B, C y D <i>Series A, B, C & D Amortisation Withholding</i> | | Actual 19.04.2024 | 5.435.170,99 | | |
| g | Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A, B, C y D <i>Available Funds applied for Amortization of Series A, B, C & D</i> | | Actual 19.04.2024 | 5.435.170,99 | | |
| h | Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i> | | | 0,00 | | |
| i | Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i> | | Initial 26.05.2006 | 1.300.020.570,99 | | |
| j | Margen medio Ponderado <i>Weighted average margin of Mortgage Loans</i> | | 19.04.2024 | 0,882474% | | |

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

| | | | | | | |
|---|---|--|--------------------------|----------------|-----------|--------|
| A | Saldo Principal Pendiente Serie A <i>Outstanding Principal Balance Series A</i> | | Precedente 19.01.2024 | 101.310.595,48 | | |
| B | Saldo Principal Pendiente Serie B <i>Outstanding Principal Balance Series B</i> | | Precedente 19.01.2024 | 5.712.033,60 | % (B / F) | 5,109% |
| C | Saldo Principal Pendiente Serie C <i>Outstanding Principal Balance Series C</i> | | Precedente 19.01.2024 | 3.264.019,20 | % (C / F) | 2,920% |
| D | Saldo Principal Pendiente Serie D <i>Outstanding Principal Balance Series D</i> | | Precedente 19.01.2024 | 1.506.888,72 | % (D / F) | 1,348% |
| E | Saldo Principal Pendiente Serie E <i>Outstanding Principal Balance Series E</i> | | Precedente 19.01.2024 | 5.850.000,00 | | |
| F | Saldo Principal Pendiente Series A, B, C y D <i>Outstanding Principal Balance Series A, B, C & D</i> | | Precedente 19.01.2024 | 111.793.537,00 | | |
| G | Importe nominal emisión Serie B <i>Issue face amount Series B</i> | | Initial | 27.300.000,00 | | |
| H | Importe nominal emisión Serie C <i>Issue face amount Series C</i> | | Initial | 15.600.000,00 | | |
| I | Importe nominal emisión Serie D <i>Issue face amount Series D</i> | | Initial | 7.200.000,00 | | |

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

| | | | | |
|---|--|------------------------|------------|--------------|
| K | Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve | Precedente / Preceding | 19.01.2024 | 5.850.000,00 |
| n | Fondo de Reserva Dotado | Precedente / Preceding | 19.01.2024 | 5.850.000,00 |
| ñ | Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve | Actual / Current | 19.04.2024 | 5.850.000,00 |
| o | Fondo de Reserva Dotado | Actual / Current | 19.04.2024 | 5.850.000,00 |

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 | Déficit de Amortización por importe mayor a la suma (i) del cincuenta por ciento (50%) del importe nominal de emisión de los Bonos de la Serie B y (ii) del cien por ciento (100%) del importe nominal de emisión de los Bonos de las Series C y D | h | > 0,5*B + C + D | 7.626.924,72 | N |
| 2.1.2 | Serie C / Series C | Déficit de Amortización por importe mayor a la suma (i) del cincuenta por ciento (50%) del importe nominal de emisión de los Bonos de la Serie C y (ii) del cien por ciento (100%) del importe nominal de emisión de los Bonos de la Serie D | h | > 0,5*C + D | 3.138.898,32 | N |
| 2.1.3 | Serie D / Series D | Déficit de Amortización por importe mayor al cincuenta por ciento (50%) del importe nominal de emisión de los Bonos de la Serie D | h | > 0,5*D | 753.444,36 | N |

NO APLICA POR ESTAR EN EL MÍNIMO

2.2 Fondo de Reserva:

Cash Reserve

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) | que en la Fecha de Pago precedente a la Fecha de Pago correspondiente, el Fondo de Reserva hubiera sido dotado en el importe del Fondo de Reserva Requerido a aquella Fecha de Pago. | k-n | = 0,00 | 0,00 | | N S/Y |
| (ii) | en la Fecha Determinación precedente a la Fecha de Pago correspondiente, el importe del Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios no Dudosos sea igual o superior al 10 por 100 del Saldo Vivo inicial a la constitución del Fondo. | | ≥ 10,00% | 8,18% | | N |

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 4,200% de la suma del Saldo de Principal Pendiente de las Series A1, A2a, A2b, B, C y D, | | ≥ 4,200% | 5,109% | | S/Y S/Y |
| (ii) | el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 1,25% del Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios no Dudosos. | | ≤ 1,25% | 0,848% | | 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 2,400% de la suma del Saldo de Principal Pendiente de las Series A1, A2a, A2b, B, C y D | | ≥ 2,400% | 2,920% | | S/Y S/Y |
| (ii) | el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 1,00% del Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios no Dudosos. | | ≤ 1,00% | 0,848% | | S/Y |

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 1,108% de la suma del Saldo de Principal Pendiente de las Series A1, A2a, A2b, B, C y D, | | ≥ 1,108% | 1,348% | | N S/Y |
| (ii) | el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 0,75% del Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios no Dudosos. | | ≤ 0,75% | 0,848% | | 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 |
|--------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------------------|---|
|--------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------------------|---|

| | | | | |
|------------|-----------|----------|-------|-----|
| 26/05/2006 | % (a / i) | < 10,00% | 8,33% | S/Y |
|------------|-----------|----------|-------|-----|