

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

Actual / Current **17.08.2023**
 Actual / Current **09.08.2023**
 Precedente / Preceding **17.05.2023**
 Precedente / Preceding **28.03.2007**

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 09.08.2023	223.521.592,87		
b	Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>	(>3 y <18 meses)	Actual 09.08.2023	1.413.734,02	% (b / e)	0,645%
c	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>	(≤ 3 meses)	Actual 09.08.2023	217.674.203,22		
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	(≥ 18 meses)	Actual 09.08.2023	4.433.655,63		
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos <i>Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans</i>	(<18 meses)	Actual 09.08.2023	219.087.937,24	% (e / f)	14,60%
f	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>		Inicial 28.03.2007	1.500.118.980,94		
g	Retención para Amortización de las Series A, B, C y D <i>Series A, B, C & D Amortization Withholding</i>	(F - e)	Actual 17.08.2023	9.679.173,63		
h	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 17.08.2023	9.679.173,63		
i	Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i>		Actual 17.08.2023	0,00		
j	Saldo Vivo Acumulado de los Préstamos Dudosos <i>Accumulated Outstanding Balance of Doubtful Loans</i>		Actual 09.08.2023	75.546.778,80		
k	Ingresos percibidos por reembolso de principal <i>Income received from repayment of principal</i>		Actual 09.08.2023	11.761.201,35		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Serie A <i>Outstanding Principal Balance Series A</i>		Precedente 17.05.2023	207.933.285,00		
B	Saldo Principal Pendiente Serie B <i>Outstanding Principal Balance Series B</i>		Precedente 17.05.2023	8.937.932,77	% (B / F)	3,907%
C	Saldo Principal Pendiente Serie C <i>Outstanding Principal Balance Series C</i>		Precedente 17.05.2023	8.693.152,65	% (C / F)	3,800%
D	Saldo Principal Pendiente Serie D <i>Outstanding Principal Balance Series D</i>		Precedente 17.05.2023	3.202.740,45	% (D / F)	1,400%
E	Saldo Principal Pendiente Serie E <i>Outstanding Principal Balance Series E</i>		Precedente 17.05.2023	7.500.000,00		
F	Saldo Principal Pendiente Series A, B, C y D. <i>Outstanding Principal Balance Series A, B, C & D.</i>		Precedente 17.05.2023	228.767.110,87		
G	Importe nominal emisión Serie A <i>Issue face amount Series A</i>		Inicial 28.03.2007	1.431.700.000,00		
H	Importe nominal emisión Serie B <i>Issue face amount Series B</i>		Inicial 28.03.2007	29.300.000,00		
I	Importe nominal emisión Serie C <i>Issue face amount Series C</i>		Inicial 28.03.2007	28.500.000,00		
J	Importe nominal emisión Serie D <i>Issue face amount Series D</i>		Inicial 28.03.2007	10.500.000,00		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

l	Fondo de Reserva Requerido / <i>Required Cash Reserve</i>		Precedente / Preceding 17.05.2023	7.500.000,00		
m	Fondo de Reserva Dotado / <i>Provisioned Cash Reserve</i>		Precedente / Preceding 17.05.2023	7.500.000,00		
n	Fondo de Reserva Requerido / <i>Required Cash Reserve</i>		Actual / Currently 17.08.2023	7.500.000,00		
ñ	Fondo de Reserva Dotado / <i>Provisioned Cash Reserve</i>		Actual / Currently 17.08.2023	7.500.000,00		

2 Situación disparadores / Triggers status
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 Saldo Vivo Ptmos Dudosos	09.08.2023	(i/f)	> 8,00%	5,04%	N
2.1.2	Serie C / Series C Saldo Vivo Ptmos Dudosos	09.08.2023	(i/f)	> 5,20%	5,04%	N
2.1.3	Serie D / Series D Saldo Vivo Ptmos Dudosos	09.08.2023	(i/f)	> 4,50%	5,04%	S/Y

NO APLICA POR ESTAR EN EL MÍNIMO

2.2 Fondo de Reserva:

Cash Reserve

2.3 Amortización a Prorrata Clase A

09.08.2023	(c+k)/A	< 1,00%	1,10	N
------------	---------	---------	------	---

2.4 Amortización a Prorrata Series B, C y D

Pro Rata Amortisation of Series B, C & D

2.4.0 Condiciones comunes / Common conditions ()**

(i)	No procede 2.3	09.08.2023	2.3	N		S/Y
(ii)	Fondo de Reserva en F.P. = Fondo de Reserva requerido	17.08.2023		= 0,00	0,00	S/Y
(iii)	Saldo Vivo Ph's no Dudosos > 10% Aldo Vivo inicial	09.08.2023		≥ 10,00%	14,60%	S/Y

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

(i)	el Saldo de Principal Pendiente de la Serie B sea igual o mayor al 3,907%	09.08.2023		≥ 3,907%	3,907%	S/Y
(ii)	el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,25%	09.08.2023		≤ 1,25%	0,645%	S/Y

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

(i)	el Saldo de Principal Pendiente de la Serie C sea igual o mayor al 3,800%	09.08.2023		≥ 3,800%	3,800%	S/Y
(ii)	el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,00%	09.08.2023		≤ 1,00%	0,645%	S/Y

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

(i)	el Saldo de Principal Pendiente de la Serie D sea igual o mayor al 1,400% de la suma del	09.08.2023		≥ 1,400%	1,400%	S/Y
(ii)	el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 0,75%	09.08.2023		≤ 0,75%	0,645%	S/Y

(*) 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
28/03/2007	% (a / g)	< 10,00%	14,90%	N