

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

Actual / Current **17.05.2024**
 Actual / Current **09.05.2024**
 Precedente / Preceding **19.02.2024**
 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 / Outstanding Balance Mortgage Loans (b + c + d)	Actual 09.05.2024 196.564.200,59		
b Saldo Vivo Préstamos Morosos (no Dudosos) / Outstanding Balance Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful) (>3 y <18 meses) / (>3 and <18 months)	Actual 09.05.2024 1.485.891,63	% (b / e)	0,772%
c Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) / Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful) (≤ 3 meses) / (≤3 months)	Actual 09.05.2024 191.053.610,71		
d Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos / Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans (≥18 meses) / (≥18 months)	Actual 09.05.2024 4.024.698,25		
e Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos / Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans (<18 meses) / (<18 months)	Actual 09.05.2024 192.539.502,34	% (e / f)	12,83%
f Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios / Outstanding Balance Mortgage Loans	Initial 28.03.2007 1.500.118.980,94		
g Retención para Amortización de las Series A, B, C y D / Series A, B, C & D Amortisation Withholding (F - e)	Actual 17.05.2024 8.242.879,57		
h Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A, B, C y D / Available Funds applied for Amortization of Series A, B, C & D	Actual 17.05.2024 8.242.879,57		
i Déficit de Amortización / Amortisation Deficiency	Actual 17.05.2024 0,00		
j Saldo Vivo Acumulado de los Préstamos Dudosos / Accumulated Outstanding Balance of Doubtful Loans	Actual 09.05.2024 75.863.023,48		
k Ingresos percibidos por reembolso de principal / Income received from repayment of principal	Actual 09.05.2024 8.159.996,02		

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A Saldo Principal Pendiente Serie A / Outstanding Principal Balance Series A	Precedente 19.02.2024 182.004.039,00		
B Saldo Principal Pendiente Serie B / Outstanding Principal Balance Series B	Precedente 19.02.2024 7.844.568,11	% (B / F)	3,907%
C Saldo Principal Pendiente Serie C / Outstanding Principal Balance Series C	Precedente 19.02.2024 7.990.066,20	% (C / F)	3,979%
D Saldo Principal Pendiente Serie D / Outstanding Principal Balance Series D	Precedente 19.02.2024 2.943.708,60	% (D / F)	1,466%
E Saldo Principal Pendiente Serie E / Outstanding Principal Balance Series E	Precedente 19.02.2024 7.500.000,00		
F Saldo Principal Pendiente Series A, B, C y D / Outstanding Principal Balance Series A, B, C & D.	Precedente 19.02.2024 200.782.381,91		
G Importe nominal emisión Serie A / Issue face amount Series A	Inicial 28.03.2007 1.431.700.000,00		
H Importe nominal emisión Serie B / Issue face amount Series B	Inicial 28.03.2007 29.300.000,00		
I Importe nominal emisión Serie C / Issue face amount Series C	Inicial 28.03.2007 28.500.000,00		
J Importe nominal emisión Serie D / Issue face amount Series D	Inicial 28.03.2007 10.500.000,00		

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

l Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Precedente / Preceding 19.02.2024 7.500.000,00		
m Fondo de Reserva Dotado / Provisioned Cash Reserve	Precedente / Preceding 19.02.2024 7.500.000,00		
n Fondo de Reserva Requerido / Required Cash Reserve	Actual / Currently 17.05.2024 7.500.000,00		
ñ Fondo de Reserva Dotado / Provisioned Cash Reserve	Actual / Currently 17.05.2024 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

Fecha datos / Data date	Disparador / Trigger	Condición / Condition	Valor Disparador / Trigger value	Actúa S/N / Breach Y/N
2.1.1 Serie B / Series B	Saldo Vivo Ptmos Dudosos	09.05.2024 (i/f) > 8,00%	5,06%	N
2.1.2 Serie C / Series C	Saldo Vivo Ptmos Dudosos	09.05.2024 (i/f) > 5,20%	5,06%	N
2.1.3 Serie D / Series D	Saldo Vivo Ptmos Dudosos	09.05.2024 (i/f) > 4,50%	5,06%	S/Y

2.2 Fondo de Reserva:

Cash Reserve

NO APLICA POR ESTAR EN EL MÍNIMO

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) No procede 2.3	09.05.2024	2.3	N		S/Y
(ii) Fondo de Reserva en F.P. = Fondo de Reserva requerido	17.05.2024		= 0,00	0,00	S/Y
(iii) Saldo Vivo Ph's no Dudosos > 10% Aldo Vivo inicial	09.05.2024		≥ 10,00%	12,83%	S/Y

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 3,907%	09.05.2024		≥ 3,907%	3,907%	S/Y
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,25%	09.05.2024		≤ 1,25%	0,772%	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 3,800%	09.05.2024		≥ 3,800%	3,979%	S/Y
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,00%	09.05.2024		≤ 1,00%	0,772%	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 1,400% de la suma del	09.05.2024		≥ 1,400%	1,466%	S/Y
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 0,75%	09.05.2024		≤ 0,75%	0,772%	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
28/03/2007	% (a / g)	< 10,00%	13,10%	N