

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

Actual / Current **19.08.2024**
 Actual / Current **09.08.2024**
 Precedente / Preceding **17.05.2024**
 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 <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>	(b + c + d) Actual 09.08.2024 Currently 09.08.2024	187.831.711,96	
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 09.08.2024 Currently 09.08.2024	1.998.605,61	% (b / e) 1,088%
c Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>	(≤ 3 meses) (≤3 months) Actual 09.08.2024 Currently 09.08.2024	181.770.060,42	
d Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	(≥18 meses) (≥18 months) Actual 09.08.2024 Currently 09.08.2024	4.063.045,93	
e Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos <i>Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans</i>	(<18 meses) (<18 months) Actual 09.08.2024 Currently 09.08.2024	183.768.666,03	% (e / f) 12,25%
f Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>	Initial 28.03.2007 Currently 19.08.2024	1.500.118.980,94	
g Retención para Amortización de las Series A, B, C y D <i>Series A, B, C & D Amortisation Withholding</i>	(F - e) Actual 19.08.2024 Currently 19.08.2024	8.770.857,56	
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 19.08.2024 Currently 19.08.2024	8.770.857,56	
i Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i>	Actual 19.08.2024 Currently 19.08.2024	0,00	
j Saldo Vivo Acumulado de los Préstamos Dudosos <i>Accumulated Outstanding Balance of Doubtful Loans</i>	Actual 09.08.2024 Currently 09.08.2024	76.007.696,98	
k Ingresos percibidos por reembolso de principal <i>Income received from repayment of principal</i>	Actual 09.08.2024 Currently 09.08.2024	8.732.488,63	

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A Saldo Principal Pendiente Serie A <i>Outstanding Principal Balance Series A</i>	Precedente 17.05.2024 Preceding 17.05.2024	174.756.792,00	
B Saldo Principal Pendiente Serie B <i>Outstanding Principal Balance Series B</i>	Precedente 17.05.2024 Preceding 17.05.2024	7.522.520,09	% (B / F) 3,907%
C Saldo Principal Pendiente Serie C <i>Outstanding Principal Balance Series C</i>	Precedente 17.05.2024 Preceding 17.05.2024	7.316.502,90	% (C / F) 3,800%
D Saldo Principal Pendiente Serie D <i>Outstanding Principal Balance Series D</i>	Precedente 17.05.2024 Preceding 17.05.2024	2.943.708,60	% (D / F) 1,529%
E Saldo Principal Pendiente Serie E <i>Outstanding Principal Balance Series E</i>	Precedente 17.05.2024 Preceding 17.05.2024	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 17.05.2024 Preceding 17.05.2024	192.539.523,59	
G Importe nominal emisión Serie A <i>Issue face amount Series A</i>	Inicial 28.03.2007 Initial 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 Initial 28.03.2007	29.300.000,00	
I Importe nominal emisión Serie C <i>Issue face amount Series C</i>	Inicial 28.03.2007 Initial 28.03.2007	28.500.000,00	
J Importe nominal emisión Serie D <i>Issue face amount Series D</i>	Inicial 28.03.2007 Initial 28.03.2007	10.500.000,00	

1.3 Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

l Fondo de Reserva Requerido / <i>Required Cash Reserve</i>	Precedente / Preceding 17.05.2024 Precedente / Preceding 17.05.2024	7.500.000,00 7.500.000,00	
m Fondo de Reserva Dotado / <i>Provisioned Cash Reserve</i>	Actual / Currently 19.08.2024 Actual / Currently 19.08.2024	7.500.000,00 7.500.000,00	

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

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	(j/f) > 8,00%	5,07%	N
2.1.2 Serie C / Series C	Saldo Vivo Ptmos Dudosos	(j/f) > 5,20%	5,07%	N
2.1.3 Serie D / Series D	Saldo Vivo Ptmos Dudosos	(j/f) > 4,50%	5,07%	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	09.08.2024	2.3	N		S/Y
(ii) Fondo de Reserva en F.P. = Fondo de Reserva requerido	19.08.2024		= 0,00	0,00	S/Y
(iii) Saldo Vivo Ph's no Dudosos > 10% Aldo Vivo inicial	09.08.2024		≥ 10,00%	12,25%	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%	09.08.2024		≥ 3,907%	3,907%	S/Y
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,25%	09.08.2024		≤ 1,25%	1,088%	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%	09.08.2024		≥ 3,800%	3,800%	N
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,00%	09.08.2024		≤ 1,00%	1,088%	N

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	09.08.2024		≥ 1,400%	1,529%	S/Y
(ii) el Saldo Vivo de los Préstamos Hipotecarios Morosos no exceda del 0,75%	09.08.2024		≤ 0,75%	1,088%	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%	12,52%	N