

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

Actual / Current	25.09.2023
Actual / Current	18.09.2023
Precedente / Preceding	26.06.2023
Precedente / Preceding	25.02.2009

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 Current	18.09.2023	420.174.143,61	
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 Current	18.09.2023	2.791.996,28	% (b / e)
	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Morosos (no Dudosos) <i>Outstanding Balance Non-Delinquent Mortgage Loans (Non-Doubtful)</i>	(≤ 3 meses) (≤ 3 months)	Actual Current	18.09.2023	417.206.588,26	
d	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios Dudosos <i>Outstanding Balance Doubtful Mortgage Loans</i>	(≥ 18 meses) (≥ 18 months)	Actual Current	18.09.2023	175.559,07	
e	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios no Dudosos <i>Outstanding Balance Non-Doubtful Mortgage Loans</i>	(<18 meses) (<18 months)	Actual Current	18.09.2023	419.998.584,54	% (e / f)
f	Saldo Vivo Préstamos Hipotecarios <i>Outstanding Balance Mortgage Loans</i>		Inicial Initial	25.02.2009	2.200.118.800,81	
g	Retención para Amortización de las Series A, B y C <i>Series A, B & C Amortisation Withholding</i>	(D + e)	Actual Current	25.09.2023	16.515.111,65	
h	Fondos Disponibles aplicados para Amortización Series A, B y C <i>Available Funds applied for Amortization of Series A, B & C</i>			25.09.2023	16.515.111,65	
i	Déficit de Amortización <i>Amortisation Deficiency</i>			25.09.2023	0,00	
j	Saldo Vivo Acumulado de los Préstamos Dudosos <i>Cumulative Outstanding Balance of Doubtful Mortgage Loans</i>			18.09.2023	77.373.271,20	
k	Margen medio Ponderado <i>Average margin</i>			18.09.2023	0,84917%	

1.2 Datos: Emisión Bonos / Data: Bond Issue

A	Saldo Principal Pendiente Serie A <i>Outstanding Principal Balance Series A</i>		Precedente Preceding	26.06.2023	402.029.108,36	
B	Saldo Principal Pendiente Serie B <i>Outstanding Principal Balance Series B</i>		Precedente Preceding	26.06.2023	10.039.816,71	% (B / F)
C	Saldo Principal Pendiente Serie C <i>Outstanding Principal Balance Series C</i>		Precedente Preceding	26.06.2023	24.444.771,12	% (C / F)
F	Saldo Principal Pendiente Series A, B, C y D. <i>Outstanding Principal Balance Series A, B, C & D.</i>		Precedente Preceding	26.06.2023	436.513.696,19	
G	Importe nominal emisión Serie A <i>Issue face amount Series A</i>		Inicial Initial	25.02.2009	2.113.100.000,00	
H	Importe nominal emisión Serie B <i>Issue face amount Series B</i>		Inicial Initial	25.02.2009	25.300.000,00	
I	Importe nominal emisión Serie C <i>Issue face amount Series C</i>		Inicial Initial	25.02.2009	61.600.000,00	

1.3 Datos: Fondo de Reserva / Data: Cash Reserve

l	Fondo de Reserva Requerido / <i>Required Cash Reserve</i>		Precedente / Preceding	26.06.2023	35.750.000,00	
m	Fondo de Reserva Dotado / <i>Provisioned Cash Reserve</i>		Precedente / Preceding		35.750.000,00	
n	Fondo de Reserva Requerido / <i>Required Cash Reserve</i>		Actual / Current	25.09.2023	35.750.000,00	
ñ	Fondo de Reserva Dotado / <i>Provisioned Cash Reserve</i>		Actual / Current		35.750.000,00	

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 y C: postergación lugar orden de prelación

Interest payment of Series B & C: place deferred in priority of payments

2.1.1 Serie B / <i>Series B</i>	Saldo Vivo acumulado Ptmos Dudosos	18.09.2023	(j/f)	> 12,00%	3,52%	N
2.1.2 Serie C / <i>Series C</i>	Saldo Vivo acumulado Ptmos Dudosos	18.09.2023	(j/f)	> 8,00%	3,52%	N

2.2 Fondo de Reserva:

Cash Reserve

NO APLICA POR ESTAR EN EL MÍNIMO

2.3 Amortización a Prorrata Series B y C

Pro Rata Amortisation of Series B & C

2.3.0 Condiciones comunes / Common conditions ()**

(i)	Fondo de Reserva en F.P. = Fondo de Reserva requerido	25.09.2023	n=ñ	= 0,00		S/Y
(ii)	Saldo Vivo Ph's no Dudosos > 10% Saldo Vivo inicial	25.09.2023	e/f	≥ 10,00%	19,09%	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 2,300%	25.09.2023	B	≥ 2,300%	2,300%	S/Y
(ii)	el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,50%	25.09.2023	b/e	≤ 1,50%	0,665%	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 5,600%	25.09.2023	C	≥ 5,600%	5,600%	S/Y
(ii)	el Saldo Vivo de los Préstamos Morosos no exceda del 1,00%	25.09.2023	b/e	≤ 1,00%	0,665%	S/Y

(*) No procede reducción si se da alguna de las condiciones / *Do not proceed reduction if any condition concurs*

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

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
--------------------------	-----------------------	-----------------------	-----------------------------------	--

18/09/2023	% (a / g)	< 10,00%	19,10%	N
------------	-----------	----------	--------	---