

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION
Número de registro del Fondo: 202100003
NIF Fondo: V05377221
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: EBN TITULIZACION, S.A., SGFT
NIF Gestora: A88248166
Fondo Abierto: SI
Fondo Privado: SI
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2023

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:
(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

SE HA LLEVADO A CABO UNA RECLASIFICACIÓN DEL ACTIVO DEL FONDO. ANTES ESTABA TODO EN LA CASILLA 16 COMO PRÉSTAMO AL CONSUMO A LARGO PLAZO Y AHORA HAY PARTE EN LA CASILLA 16 Y OTRA PARTE EN LA CASILLA 57 DE PRÉSTAMOS A CORTO PLAZO.

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	10.447	1001	13.788
I. Activos financieros a largo plazo	0002	9.227	1002	12.267
1. Activos titulizados	0003	9.227	1003	12.267
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	0	1005	0
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007	0	1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008	0	1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009	0	1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010	0	1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016	8.437	1016	12.202
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	0
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022	0	1022	0
1.20 Otros	0023	0	1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	1.631	1025	87
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-840	1027	-22
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	1.220	1040	1.521

S.01
Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora:
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	6.960	1041	12.966
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	5.402	1043	7.848
1. Activos titulizados	0044	5.220	1044	7.720
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	0	1046	0
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048	0	1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049	0	1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050	0	1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051	0	1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052	0	1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053	0	1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054	0	1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055	0	1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056	0	1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057	5.052	1057	7.188
1.14 Préstamos automoción	0058	0	1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060	0	1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061	0	1061	0
1.18 Bonos de titulización	0062	0	1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063	0	1063	0
1.20 Otros	0064	0	1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	107	1065	123
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	61	1066	19
1.23 Activos dudosos -principal-	0067		1067	886
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	0	1068	42
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	0	1069	-538
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	182	1074	128
3.1 Valores representativos de deuda	0075	0	1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076	0	1076	0
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	182	1077	128
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081	0	1081	0
VI. Ajustes por periodificaciones	0082		1082	
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	1.558	1085	5.118
1. Tesorería	0086	1.558	1086	5.118
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	17.407	1088	26.755

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	17.206	1089	26.527
I. Provisiones a largo plazo	0090		1090	
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	0	1092	0
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	17.206	1094	26.527
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	17.206	1095	26.527
1.1 Series no subordinadas	0096	25.200	1096	32.200
1.2 Series subordinadas	0097	0	1097	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	-7.994	1098	-5.673
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101		1101	
2.1 Préstamo subordinado	0102	0	1102	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108		1108	
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

S.01
Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora:
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) PASIVO CORRIENTE	0117	201	1117	228
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	61	1123	74
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	61	1124	74
1.1 Series no subordinadas	0125	0	1125	0
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	61	1128	74
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131		1131	
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	0	1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	0	1136	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139		1139	
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	0
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143		1143	
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	140	1148	154
1. Comisiones	0149	5	1149	4
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	5	1150	4
1.2 Comisión administrador	0151	37	1151	6
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153		1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-37	1155	-6
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	135	1157	150
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158		1158	
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	0	1160	0
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	17.407	1162	26.755

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2023		Acumulado anterior 31/12/2022
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	436	1201	575	2201	1.842	3201	1.688
1.1 Activos titulizados	0202	436	1202	575	2202	1.842	3202	1.688
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-290	1204	-333	2204	-1.338	3204	-948
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-290	1205	-333	2205	-1.338	3205	-948
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	0	1206	0	2206	0	3206	0
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	0	1208	0	2208	0	3208	0
A) MARGEN DE INTERESES	0209	146	1209	243	2209	504	3209	740
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210		1210		2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-165	1217	-65	2217	-427	3217	-193
7.1 Servicios exteriores	0218	-58	1218	-2	2218	-125	3218	-6
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-58	1219	-2	2219	-125	3219	-6
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-107	1224	-63	2224	-301	3224	-187
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-23	1225	-26	2225	-103	3225	-77
7.3.2 Comisión administrador	0226	-84	1226	-36	2226	-197	3226	-109
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227	0	3227	0
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	-1	3230	-1
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-1.607	1231	-83	2231	-2.430	3231	-622
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-1.607	1232	-83	2232	-2.430	3232	-622
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234		1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236	0	3236	0
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238	0	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	1.627	1239	-95	2239	2.352	3239	75
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240		2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2023		Acumulado anterior 31/12/2022
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	30	1300	123	2300	393	3300	954
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	211	1301	237	2301	790	3301	1.264
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	448	1302	526	2302	1.896	3302	2.331
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-237	1303	-289	2303	-1.106	3303	-1.067
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-123	1309	-62	2309	-269	3309	-251
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-23	1310	-25	2310	-102	3310	-103
2.2 Comisión administrador	0311	-101	1311	-37	2311	-166	3311	-147
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	-1	3312	-1
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-58	1315	-52	2315	-128	3315	-59
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-58	1320	-52	2320	-128	3320	-59
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-1.358	1322	-141	2322	-3.954	3322	2.571
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	3.000
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	-3.114	1324	-3.232	2324	-8.493	3324	-15.098
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	1.853	1325	3.152	2325	4.795	3325	14.893
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	1.154	1326	1.618	2326	4.929	3326	6.337
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.308	1327	1.263	2327	5.334	3327	6.960
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	297	1328	180	2328	1.114	3328	801
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	93	1329	92	2329	417	3329	794
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-1.000	1331	0	2331	-7.000	3331	0
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-97	1332	-61	2332	-256	3332	-223
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	-64	1335	-61	2335	-256	3335	-223
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-33	1336	0	2336	0	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-1.328	1337	-17	2337	-3.561	3337	3.525
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	2.886	1338	5.136	2338	5.118	3338	1.593
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	1.558	1339	5.118	2339	1.558	3339	5.118

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2023		Acumulado anterior 31/12/2022
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350		1350		2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351		1351		2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352		1352		2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353		1353		2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354		1354		2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0355		1355		2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356		1356		2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357		1357		2357		3357	
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358		1358		2358		3358	
2.1.2 Efecto fiscal	0359		1359		2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360		1360		2360		3360	
2.3 Otras reclasificaciones	0361		1361		2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362		1362		2362		3362	
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363		1363		2363		3363	
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	0364		1364		2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365		1365		2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366		1366		2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367		1367		2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368		1368		2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369		1369		2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370		1370		2370		3370	

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2023								Situación cierre anual anterior 31/12/2022								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381		0401		0421		0441		1381		1401		1421		1441		2381		2401		2421		2441	
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392	10,79	0412	32,89	0432	5,33	0452	16,17	1392	4,78	1412	21,26	1432	12,61	1452	18,42	2392	2,63	2412	0,00	2432	0,00	2452	0,00
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	288	0467	28	0474	9	0481	0	0488	38	0495	1.008	0502	0	0509	1.045
De 1 a 3 meses	0461	231	0468	28	0475	7	0482	0	0489	35	0496	510	0503	0	0510	546
De 3 a 6 meses	0462	199	0469	108	0476	12	0483	13	0490	133	0497	361	0504	0	0511	494
De 6 a 9 meses	0463	213	0470	542	0477	12	0484	86	0491	640	0498	60	0505	0	0512	700
De 9 a 12 meses	0464	222	0471	560	0478	12	0485	89	0492	662	0499	0	0506	0	0513	662
Más de 12 meses	0465		0472		0479		0486	0	0493		0500		0507	0	0514	
Total	0466	1.153	0473	1.266	0480	53	0487	188	0494	1.508	0501	1.939	0508		1515	3.447

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado				Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total		Valor garantía		Valor Garantía con Tasación > 2 años		% Deuda / v. Tasación					
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad														Intereses interrumpidos en contabilidad		Total	
Hasta 1 mes	0515		0522		0529		0536		0543		0550		0557		0564		0571		0578		0584	
De 1 a 3 meses	0516		0523		0530		0537		0544		0551		0558		0565		0572		0579		0585	
De 3 a 6 meses	0517		0524		0531		0538		0545		0552		0559		0566		0573		0580		0586	
De 6 a 9 meses	0518		0525		0532		0539		0546		0553		0560		0567		0574		0581		0587	
De 9 a 12 meses	0519		0526		0533		0540		0547		0554		0561		0568		0575		0582		0588	
Más de 12 meses	0520		0527		0534		0541		0548		0555		0562		0569		0576		0583		0589	
Total	0521		0528		0535		0542		0549		0556		0563		0570		0577				0590	

S.05.1

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 08/04/2021	
Inferior a 1 año	0600	2.116	1600	1.703	2600	5.173
Entre 1 y 2 años	0601	1.728	1601	3.632	2601	6.319
Entre 2 y 3 años	0602	4.155	1602	3.214	2602	8.962
Entre 3 y 4 años	0603	4.180	1603	7.846	2603	17.167
Entre 4 y 5 años	0604	1.544	1604	3.897	2604	13.829
Entre 5 y 10 años	0605	1.397	1605	72	2605	7.505
Superior a 10 años	0606		1606		2606	
Total	0607	15.120	1607	20.364	2607	58.957
Vida residual media ponderada (años)	0608	2,89	1608	2,92	2608	3,27

Antigüedad	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 08/04/2021	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	1,28	1609	1,20	2609	0,64

S.05.1

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 08/04/2021			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620		0630		1620		1630		2620		2630	
40% - 60%	0621		0631		1621		1631		2621		2631	
60% - 80%	0622		0632		1622		1632		2622		2632	
80% - 100%	0623		0633		1623		1633		2623		2633	
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624		2634	
120% - 140%	0625		0635		1625		1635		2625		2635	
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626		2636	
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627		2637	
Total	0628		0638		1628		1638		2628		2638	
Media ponderada (%)	0639		0649		1639		1649		2639		2649	

WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

S.05.1

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 08/04/2021	
Tipo de interés medio ponderado	0650	10,82	1650	10,74	2650	10,64
Tipo de interés nominal máximo	0651	18,46	1651	24,66	2651	24,66
Tipo de interés nominal mínimo	0652	4,81	1652	4,81	2652	4,81

S.05.1

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 08/04/2021			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	875	0683	1.706	1660	959	1683	2.450	2660	2.623	2683	7.835
Aragón	0661	181	0684	431	1661	166	1684	605	2661	498	2684	1.630
Asturias	0662	78	0685	246	1662	69	1685	244	2662	187	2685	686
Baleares	0663	236	0686	493	1663	211	1686	736	2663	655	2686	2.108
Canarias	0664	357	0687	852	1664	348	1687	1.063	2664	897	2687	3.033
Cantabria	0665	64	0688	137	1665	64	1688	178	2665	212	2688	631
Castilla-León	0666	182	0689	448	1666	177	1689	448	2666	559	2689	1.685
Castilla La Mancha	0667	236	0690	469	1667	246	1690	671	2667	758	2690	2.084
Cataluña	0668	1.288	0691	3.341	1668	1.303	1691	4.417	2668	3.651	2691	12.461
Ceuta	0669	13	0692	27	1669	14	1692	32	2669	57	2692	133
Extremadura	0670	69	0693	149	1670	68	1693	187	2670	198	2693	577
Galicia	0671	205	0694	571	1671	189	1694	713	2671	502	2694	1.813
Madrid	0672	1.430	0695	3.516	1672	1.528	1695	5.120	2672	4.488	2695	14.145
Melilla	0673	7	0696	26	1673	8	1696	30	2673	30	2696	109
Murcia	0674	193	0697	429	1674	197	1697	585	2674	493	2697	1.522
Navarra	0675	68	0698	195	1675	57	1698	150	2675	168	2698	600
La Rioja	0676	29	0699	58	1676	31	1699	82	2676	113	2699	290
Comunidad Valenciana	0677	634	0700	1.584	1677	627	1700	1.987	2677	1.727	2700	5.779
País Vasco	0678	192	0701	443	1678	208	1701	665	2678	627	2701	1.837
Total España	0679	6.337	0702	15.120	1679	6.470	1702	20.364	2679	18.443	2702	58.957
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680		2703	
Resto	0681		0704		1681		1704		2681		2704	
Total general	0682	6.337	0705	15.120	1682	6.470	1705	20.364	2682	18.443	2705	58.957

WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

S.05.1
Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora:
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2023
Entidades cedentes de los activos titulizados: NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 08/04/2021			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	2,31			1710	2,25			2710	0,95		
Sector	0711		0712	-	1711		1712		2711		2712	-

S.05.2

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 08/04/2021					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
	BONOS	262	96.183	25.200	322	100.000	32.200	322	100.000	32.200			
Total		0723	262	0724	25.200	1723	322	1724	32.200	2723	322	2724	32.200

S.05.2
Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora:
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/12/2023
Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
						0730	0731			0732	0733	0734	0735			0736	0737
	BONOS	NS	FIJO	0,00	4,40	61	0	SI	25.200	0	25.261	-7.994					
Total						0740	61	0741	0	0743	25.200	0744	0	0745	25.261	0746	-7.994

	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 08/04/2021	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	4,40	0748	4,40	0749	4,20

S.05.2
Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora:
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/12/2023
Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2023								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2022							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
	BONOS	1.000	7.000	237	2.770	0	0	289	1.664								
Total		0754	1.000	0755	7.000	0756	237	0757	2.770	1754	0	1755	0	1756	289	1757	1.664

S.05.2
Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora:
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/12/2023
Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 08/04/2021
		0760	0761	0762	0763	0764

S.05.2

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 08/04/2021	
Inferior a 1 año	0765		1765		2765	
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	
Entre 5 y 10 años	0770	25.200	1770	32.200	2770	32.200
Superior a 10 años	0771		1771		2771	
Total	0772	25.200	1772	32.200	2772	32.200
Vida residual media ponderada (años)	0773	7,19	1773	8,19	2773	9,72

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 08/04/2021	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	262	1775	322	2775	322
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	262	1776	322	2776	322
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	1,04	1777	1,00	2777	1,00
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.	1778	NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.	2778	NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786		1786		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	N	1791	N	2791	N
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100,00	1792	100,00	2792	100,00
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

S.05.3
Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora:
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características		
Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 08/04/2021			
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806		
Total						0808		0809		0810	

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 08/04/2021		Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 08/04/2021			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002		7003		7006		7009		7012		7015			
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005		7008		7011		7014		7017		7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	3	7020		7021	13.177	7024	10.339	7027	49,56	7030	34,76	7033	50,15		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022		7025		7028		7031		7034			
Total Fallidos					7023	13.177	7026	10.339	7029	49,56	7032	34,76	7035	50,15	7036	ESCRITUR A DE CONSTRU CION. ANEXO 1

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

S.05.4

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	EBN TITULIZACION S.A.U., S.G.F.T.	1862	2	2862	VNP MEDIO DC	3862	0,250	4862	90	5862		6862	MENSUAL	7862	S	8862	EL IMPORTE MÁXIMO ES ANUALMENTE
Comisión administrador	0863	NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.	1863		2863	VNP MEDIO DC	3863	1,350	4863		5863		6863	MENSUAL	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	EBN BANCO DE NEGOCIOS, S.A.	1864		2864		3864		4864		5864		6864	MENSUAL	7864	S	8864	EN FUNCIÓN DEL NÚMERO DE TRANSFERENCIAS
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865	MENSUAL	7865	S	8865	

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	S
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	N
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo												Total
		31/01/2023	28/02/2023	31/03/2023	30/04/2023	31/05/2023	30/06/2023	31/07/2023	31/08/2023	30/09/2023	31/10/2023	30/11/2023	31/12/2023	
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872													
Margen de intereses	0873	-27	-75	128	21	14	100	43	100	54	136	44	75	614
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	-117	-85	-77	-72	-106	-51	-40	-107	-168	-241	-462	-428	-1.954
Dotaciones a provisiones (neto)	0875													
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876													
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-22	-21	-23	-22	-51	-19	-38	-20	-45	-319	-50	-101	-732
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	-167	-180	28	-74	-143	30	-35	-27	-159	-424	-467	-454	-2.072
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879													
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880													
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881													
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	167	180	-28	74	143	-30	35	27	159	424	467	454	2.072
Comisión variable pagada	0883													
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884													

S.05.5
Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora:
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885													
Saldo inicial	0886													
Cobros del periodo	0887													
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888													
Pagos por derivados	0889													
Retención importe Fondo de Reserva	0890													
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891													
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892													
Resto pagos/retenciones	0893													
Saldo disponible	0894													
Liquidación de comisión variable	0895													

S.06

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

INFORME SOBRE EL CUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE RIESGOS