

**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: 30/09/2022

**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)

**Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2022**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2022		Periodo anterior 31/12/2021
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	21.308	1001	20.753
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	19.236	1002	18.682
1. Activos titulizados	0003	19.236	1003	18.682
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	0	1005	
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007	0	1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008	0	1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009	0	1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010	0	1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	
1.13 Préstamos consumo	0016	19.236	1016	18.682
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022	0	1022	
1.20 Otros	0023	0	1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	0	1025	
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	
3.4 Otros	0036	0	1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039	0	1039	
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0040	2.072	1040	2.072

**Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2022**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2022		Periodo anterior 31/12/2021
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	5.722	1041	3.346
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	0	1042	
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	586	1043	1.753
1. Activos titulizados	0044	422	1044	1.617
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	0	1046	
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048	0	1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049	0	1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050	0	1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051	0	1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052	0	1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053	0	1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054	0	1054	
1.11 Deuda subordinada	0055	0	1055	
1.12 Créditos AAPP	0056	0	1056	
1.13 Préstamos consumo	0057	0	1057	1.155
1.14 Préstamos automoción	0058	0	1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	
1.16 Cuentas a cobrar	0060	0	1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061	0	1061	
1.18 Bonos de titulización	0062	0	1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063	0	1063	
1.20 Otros	0064	0	1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	337	1065	376
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	85	1066	85
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	0	1067	0
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	0	1068	0
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	0	1069	
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	
3. Otros activos financieros	0074	164	1074	136
3.1 Valores representativos de deuda	0075	0	1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076	0	1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	164	1077	
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	
3.5 Otros	0079	0	1079	136
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081	0	1081	
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0082		1082	
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	
<b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b>	0085	5.136	1085	1.593
1. Tesorería	0086	5.136	1086	1.593
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	27.029	1088	24.100

**Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2022**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2022		Periodo anterior 31/12/2021
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	26.891	1089	23.967
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0090		1090	
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	
2. Provisión por margen de intermediación	0092	0	1092	
3. Otras provisiones	0093	0	1093	
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0094	26.891	1094	23.967
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	26.891	1095	23.967
1.1 Series no subordinadas	0096	32.200	1096	29.200
1.2 Series subordinadas	0097	0	1097	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	-5.309	1098	-5.233
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101		1101	
2.1 Préstamo subordinado	0102	0	1102	
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	
3. Derivados	0108		1108	
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	
4.1 Otros	0114	0	1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0116	0	1116	

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2022		Periodo anterior 31/12/2021
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	138	1117	133
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0118	0	1118	
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	
3. Otras provisiones	0122	0	1122	
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0123	70	1123	71
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	70	1124	71
1.1 Series no subordinadas	0125	0	1125	
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	70	1128	71
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131		1131	
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	0	1134	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	0	1136	
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	
3. Derivados	0139		1139	
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	
4. Otros pasivos financieros	0143		1143	
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	
4.3 Otros	0146	0	1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	68	1148	62
1. Comisiones	0149	4	1149	5
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	4	1150	5
1.2 Comisión administrador	0151	5	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-5	1155	
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	
2. Otros	0157	64	1157	57
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158		1158	
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159	0	1159	
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	0	1160	
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161	0	1161	
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	27.029	1162	24.100

**Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2022**

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2022		Acumulado anterior 30/09/2021
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	575	1201	725	2201	1.688	3201	1.674
1.1 Activos titulizados	0202	575	1202	725	2202	1.688	3202	1.674
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-333	1204	-292	2204	-948	3204	-483
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-333	1205	-292	2205	-948	3205	-483
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	0	1206	0	2206	0	3206	
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	0	1208		2208	0	3208	
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	243	1209	433	2209	740	3209	1.192
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0210		1210		2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211		2211	0	3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212		2212	0	3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213		2213	0	3213	
4.4 Otros	0214	0	1214		2214	0	3214	
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0215	0	1215		2215	0	3215	
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0216	0	1216		2216	0	3216	
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-65	1217	-433	2217	-193	3217	-1.010
7.1 Servicios exteriores	0218	-2	1218	-1	2218	-6	3218	-8
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-2	1219	-1	2219	-6	3219	-8
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220		2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221		2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222		2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223		2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-63	1224	-432	2224	-187	3224	-1.001
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-26	1225	-25	2225	-77	3225	-41
7.3.2 Comisión administrador	0226	-36	1226	-34	2226	-109	3226	-52
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227	0	3227	0
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	-373	2228	0	3228	-908
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
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	-83	1231	-1.026	2231	-622	3231	-2.623
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-83	1232	-1.026	2232	-622	3232	-2.623
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233		2233	0	3233	
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0234		1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235		2235	0	3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236		2236	0	3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237		2237	0	3237	
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0238	0	1238		2238	0	3238	
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	-95	1239	1.026	2239	75	3239	2.442
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0240		1240		2240	0	3240	
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0241	0	1241		2241	0	3241	
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	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: 30/09/2022

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2022		Acumulado anterior 30/09/2021
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	378	1300	208	2300	831	3300	51
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	442	1301	267	2301	1.027	3301	136
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	714	1302	495	2302	1.805	3302	495
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-272	1303	-229	2303	-778	3303	-359
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304		2304	0	3304	
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305		2305	0	3305	
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306		2306	0	3306	
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-64	1309	-59	2309	-189	3309	-85
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-27	1310	-24	2310	-79	3310	-37
2.2 Comisión administrador	0311	-37	1311	-34	2311	-110	3311	-47
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	-1	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	0	1313		2313	0	3313	
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314		2314	0	3314	
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>	0315	0	1315		2315	-7	3315	0
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316		2316	0	3316	
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317		2317	0	3317	
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318		2318	0	3318	
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319		2319	0	3319	
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	-7	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	1.441	1322	-446	2322	2.712	3322	949
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	0323	2.000	1323	500	2323	3.000	3323	3.332
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	0324	-4.143	1324	-4.410	2324	-11.866	3324	-9.002
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	0325	3.640	1325	3.337	2325	11.741	3325	6.497
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	1.414	1326	2.116	2326	4.720	3326	5.215
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.865	1327	1.097	2327	5.697	3327	1.097
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	194	1328	21	2328	622	3328	83
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	168	1329	103	2329	702	3329	103
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330		2330	0	3330	
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	0	1331		2331	0	3331	
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	-56	1332	127	2332	-162	3332	122
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333		2333	0	3333	
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334		2334	0	3334	
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	-56	1335	-29	2335	-162	3335	-35
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	156	2336	0	3336	156
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	1.819	1337	-238	2337	3.543	3337	1.000
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	3.317	1338	1.238	2338	1.593	3338	
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	5.136	1339	1.000	2339	5.136	3339	1.000

**Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2022**

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2022		Acumulado anterior 30/09/2021
<b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>								
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	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>0356</b>		<b>1356</b>		<b>2356</b>		<b>3356</b>	
<b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>								
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	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>0363</b>		<b>1363</b>		<b>2363</b>		<b>3363</b>	
<b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>								
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	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>0369</b>		<b>1369</b>		<b>2369</b>		<b>3369</b>	
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>0370</b>		<b>1370</b>		<b>2370</b>		<b>3370</b>	

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2022

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

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2022								Situación cierre anual anterior 31/12/2021								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	0,00	0412	25,29	0432	11,19	0452	18,74	1392	0,00	1412	22,66	1432	4,02	1452	10,41	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: 30/09/2022

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	102	0467	12	0474	3	0481	0	0488	16	0495	334	0502	0	0509	350
De 1 a 3 meses	0461	80	0468	18	0475	5	0482	0	0489	23	0496	238	0503	0	0510	261
De 3 a 6 meses	0462		0469		0476		0483	0	0490		0497		0504	0	0511	
De 6 a 9 meses	0463		0470		0477		0484	0	0491		0498		0505	0	0512	
De 9 a 12 meses	0464		0471		0478		0485	0	0492		0499		0506	0	0513	
Más de 12 meses	0465		0472		0479		0486	0	0493		0500		0507	0	0514	
<b>Total</b>	0466	<b>182</b>	0473	<b>30</b>	0480	<b>9</b>	0487		0494	<b>39</b>	0501	<b>572</b>	0508		1515	<b>611</b>

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	
<b>Total</b>	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: 30/09/2022**

**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 30/09/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 08/04/2021	
Inferior a 1 año	0600	953	1600	1.155	2600	4.874
Entre 1 y 2 años	0601	3.119	1601	3.062	2601	5.808
Entre 2 y 3 años	0602	4.162	1602	5.995	2602	8.151
Entre 3 y 4 años	0603	6.384	1603	3.909	2603	13.646
Entre 4 y 5 años	0604	4.447	1604	5.400	2604	9.631
Entre 5 y 10 años	0605	170	1605	316	2605	5.129
Superior a 10 años	0606		1606		2606	
<b>Total</b>	0607	<b>19.236</b>	1607	<b>19.836</b>	2607	<b>47.239</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>3,06</b>	1608	<b>3,00</b>	2608	<b>3,07</b>

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 08/04/2021	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	1,17	1609	0,78	2609	0,80

Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora:

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2022

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 30/09/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	
<b>Total</b>	0628		0638		1628		1638		2628		2638	
<b>Media ponderada (%)</b>	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: 30/09/2022**

**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 30/09/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 08/04/2021	
	Tipo de interés medio ponderado	0650	10,72	1650	10,74	2650
Tipo de interés nominal máximo	0651	24,66	1651	24,00	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: 30/09/2022

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 30/09/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	1.190	0683	2.483	1660	1.072	1683	2.810	2660	2.346	2683	6.604
Aragón	0661	208	0684	552	1661	174	1684	547	2661	421	2684	1.304
Asturias	0662	79	0685	221	1662	52	1685	162	2662	147	2685	469
Baleares	0663	254	0686	699	1663	214	1686	693	2663	562	2686	1.691
Canarias	0664	396	0687	1.006	1664	321	1687	984	2664	756	2687	2.426
Cantabria	0665	83	0688	175	1665	78	1688	219	2665	188	2688	508
Castilla-León	0666	202	0689	460	1666	182	1689	545	2666	479	2689	1.258
Castilla La Mancha	0667	321	0690	664	1667	277	1690	698	2667	677	2690	1.736
Cataluña	0668	1.601	0691	4.109	1668	1.321	1691	4.181	2668	3.146	2691	9.782
Ceuta	0669	16	0692	33	1669	12	1692	32	2669	51	2692	117
Extremadura	0670	87	0693	195	1670	65	1693	181	2670	173	2693	480
Galicia	0671	223	0694	655	1671	177	1694	576	2671	413	2694	1.412
Madrid	0672	1.922	0695	4.706	1672	1.655	1695	4.947	2672	3.970	2695	11.380
Melilla	0673	12	0696	33	1673	8	1696	17	2673	26	2696	88
Murcia	0674	216	0697	562	1674	178	1697	530	2674	422	2697	1.240
Navarra	0675	73	0698	144	1675	59	1698	165	2675	133	2698	414
La Rioja	0676	43	0699	67	1676	38	1699	99	2676	103	2699	242
Comunidad Valenciana	0677	761	0700	1.834	1677	643	1700	1.897	2677	1.477	2700	4.556
País Vasco	0678	284	0701	635	1678	208	1701	554	2678	559	2701	1.531
<b>Total España</b>	0679	<b>7.971</b>	0702	<b>19.236</b>	1679	<b>6.734</b>	1702	<b>19.836</b>	2679	<b>16.049</b>	2702	<b>47.239</b>
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680		2703	
Resto	0681		0704		1681		1704		2681		2704	
<b>Total general</b>	0682	<b>7.971</b>	0705	<b>19.236</b>	1682	<b>6.734</b>	1705	<b>19.836</b>	2682	<b>16.049</b>	2705	<b>47.239</b>

**WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/09/2022</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: NEXTGEN FINANCIAL SERVICES S.L.</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 30/09/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Situación inicial 08/04/2021			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,74			1710	1,65			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: 30/09/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos:

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2022			Situación cierre anual anterior 31/12/2021			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	322	100.000	32.200	292	100.000	29.200	322	100.000	32.200			
<b>Total</b>		0723	322	0724	32.200	1723	292	1724	29.200	2723	322	2724	32.200

<b>S.05.2</b>
<b>Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Periodo de la declaración: 30/09/2022</b>
<b>Mercados de cotización de los valores emitidos:</b>

**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			0742	0736
	BONOS	NS	FIJO	0,00	4,40	70	0	SI	32.200	0	32.270	-5.309					
<b>Total</b>						0740	70	0741	0	0743	32.200	0744	0	0745	32.270	0746	-5.309

	Situación actual 30/09/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 08/04/2021	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	4,40	0748	4,20	0749	4,20

<b>S.05.2</b>
<b>Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Periodo de la declaración: 30/09/2022</b>
<b>Mercados de cotización de los valores emitidos:</b>

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO C**

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2022								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2021							
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	1750	1751	1752	1753								
	BONOS	0	0	272	1.374	0	0	229	359								
<b>Total</b>		0754	0	0755	0	0756	272	0757	1.374	1754	0	1755	0	1756	229	1757	359

<b>S.05.2</b>
<b>Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Periodo de la declaración: 30/09/2022</b>
<b>Mercados de cotización de los valores emitidos:</b>

**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 30/09/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	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: 30/09/2022

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 30/09/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		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	32.200	1770	29.200	2770	32.200
Superior a 10 años	0771		1771		2771	
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>32.200</b>	<b>1772</b>	<b>29.200</b>	<b>2772</b>	<b>32.200</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>8,45</b>	<b>1773</b>	<b>9,19</b>	<b>2773</b>	<b>9,72</b>

**Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION**

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:**

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2022**

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 08/04/2021	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	322	1775	292	2775	322
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	322	1776	292	2776	322
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	1,00	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: 30/09/2022

**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 30/09/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	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: 30/09/2022

**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 30/09/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 08/04/2021		Situación actual 30/09/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		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			
<b>Total</b>	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

<b>S.05.4</b>
<b>Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/09/2022</b>

**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 30/09/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación actual 30/09/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	10.313	7024	9.866	7027	35,06	7030	33,16	7033	34,95		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022		7025		7028		7031		7034			
Total Fallidos					7023	10.313	7026	9.866	7029	35,06	7032	33,16	7035	34,95	7036	ESCRITUR A DE CONSTRU CION. ANEXO 1

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021			
	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: 30/09/2022

**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

<b>S.05.5</b>
<b>Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/09/2022</b>

**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	0,500	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: 30/09/2022

**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		
		31/01/2022	28/02/2022	31/03/2022	30/04/2022	31/05/2022	30/06/2022	31/07/2022	31/08/2022	30/09/2022				
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872													
Margen de intereses	0873	83	99	87	140	14	74	69	73	101				740
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	-93	-177	-74	-18	-91	-87	-102	2	17				-621
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	-20	-21	-9	-35	-22	-22	-21	-22				-193
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	-31	-98	-7	113	-111	-34	-55	54	96				-75
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879													
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880				-113				-54	-96				-263
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881													
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	31	98	7		111	34	55						338
Comisión variable pagada	0883													
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884													

<b>S.05.5</b>
<b>Denominación Fondo: WANNA XXI, FONDO DE TITULIZACION</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/09/2022</b>

**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: 30/09/2022**

**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**