



AYT ADMINISTRACIONES I, F.T.A.

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE REGLAS DE FUNCIONAMIENTO

ACTIVOS SUBYACENTES

NIVELES DE MOROSIDAD Y FALLIDOS

Ver estado S05.4

RENEGOCIACIONES DE LOS ACTIVOS

| | LÍMITE A LA RENEGOCIACIÓN | |
|-------------------------------|---------------------------|---------------|
| | DEFINICIÓN DOCUMENTACIÓN | LIMITE ACTUAL |
| NOVACIONES DE TIPO DE INTERES | N/A | N/A |
| FECHA FINALIZACION | N/A | N/A |

FECHA DE VENCIMIENTO

| | DEFINICIÓN DOCUMENTACIÓN |
|-------------------------|--------------------------|
| FECHA VENCIMIENTO FINAL | 30/04/2025 |
| FECHA VENCIMIENTO LEGAL | 28/04/2028 |

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

| Frecuencia de pago de cupón | ANUAL | |
|---|-------|-------|
| | | |
| Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil) | 27 | ABRIL |

| | | |
|---------------------------------|------------|--|
| Anterior Fecha de Pago de Cupón | 27/04/2017 | |
| Anterior Fecha de Determinación | 25/04/2017 | 2 días hábiles antes de la Fecha de Pago |
| Próxima Fecha de Pago | 27/04/2018 | |

FIJACIÓN DE TIPO DE INTERÉS: TIPO DE INTERÉS DEL PRÓXIMO PERÍODO

| | ÍNDICE DE REFERENCIA * | MARGEN | FECHA FIJACIÓN | VALOR INDICE REFERENCIA | TIPO DE INTERÉS APLICABLE |
|---------|------------------------|--------|----------------|-------------------------|---------------------------|
| TRAMO A | NA | NA | NA | NA | 4,725% |
| TRAMO B | NA | NA | NA | NA | 4,725% |
| TRAMO C | NA | NA | NA | NA | 4,725% |
| TRAMO D | NA | NA | NA | NA | 4,725% |

INFORMACIÓN ADICIONAL

FONDO PRIVADO

CONTRAPARTIDAS

| CONTRAPARTIDA | ENTIDAD | DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <i>Agente de Pagos</i> | HSBC BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA | HSBC BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA |
| <i>Depositario Cuenta Tesorería</i> | HSBC BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA | HSBC BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA |
| <i>Contrapartida Swap</i> | NO APLICA | NO APLICA |
| <i>Depositario Garantía Swap</i> | NO APLICA | NO APLICA |
| <i>Administrador</i> | FMS-WERTMANAGEMENT | FMS-WERTMANAGEMENT |
| <i>Depositario Reserva Commingling</i> | NO APLICA | NO APLICA |
| <i>Back up Servicer</i> | NO APLICA | NO APLICA |
| <i>Acreditante Línea Liquidez</i> | NO APLICA | NO APLICA |
| <i>Depositario Garantía Línea Liquidez</i> | NO APLICA | NO APLICA |
| <i>Avalista</i> | NO APLICA | NO APLICA |

ACCIONES CORRECTIVAS

CONCLUIDAS

| ACCIÓN | FECHA | ENTIDAD DEPOSITARIA |
|--|------------|-----------------------------------|
| Incorporación de CECABANK, S.A. como Agente Financiero en sustitución de Banco Pastor | 17/04/2009 | CECABANK, S.A. |
| Incorporación de Defpa Bank como Administrador de los derechos de crédito en sustitución de Banco Pastor. | 10/03/2010 | DEPFA BANK |
| 1ª Escritura de Modificación a los efectos de modificar los términos en los cuáles se puede proceder con la sustitución del Administrador. | 10/03/2010 | |
| 2ª Escritura de Modificación a los efectos de modificar las fechas de pago de los bonos derivados del Fondo, además de para modificar los criterios para la sustitución del Agente Financiero. | 13/03/2012 | |
| Formalización de un contrato de Novación del Contrato de Prestación de Servicios Financieros con CECABANK, S.A. | 13/03/2012 | |
| Incorporación de HSBC en sustitución de CECABANK como Agente Financiero | 10/01/2013 | HSBC BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA |
| 3ª Escritura de Modificación a los efectos de sustituir al Administrador e incorporar la posibilidad de renuncia del Administrador de su posición. | 05/12/2014 | |
| Incorporación de FMS-WERTMANAGEMENT como Administrador de los Activos | 05/12/2014 | FMS-WERTMANAGEMENT |

RATING MÍNIMO CONTRAPARTIDAS EN DOCUMENTACIÓN

AGENTE DE PAGOS / DEPOSITARIO CUENTA

| CONDICIONES DOCUMENTACIÓN | | | | |
|---------------------------|------------------------|-------------|-------------------|---------------------|
| AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
| | Largo plazo | Corto plazo | | |
| STANDARD & POORS | A | A-1 | 30 | Hábiles |
| MOODY'S | A2 | P-1 | 30 | Hábiles |

| RATING CONTRAPARTIDA | | | | | |
|-----------------------------------|-------------------------|------------------------|-------------|------------------|-------------------|
| ENTIDAD CONTRAPARTIDA | AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | TRIGGER ACTIVADO | PLAZO SUBSANACIÓN |
| | | Largo plazo | Corto plazo | | |
| HSBC BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA | STANDARD & POORS | AA- | A-1+ | NO | N/P |
| | MOODY'S | Aa2 | P-1 | NO | N/P |

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

SIN ACTUACIONES PENDIENTES