



# AYT GÉNOVA HIPOTECARIO IX, F.T.H.

## 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	El Administrador no podrá, en ningún caso (ni siquiera a instancias de la Sociedad Gestora), entablar renegociaciones de tipo de interés que puedan resultar en una disminución del tipo de interés aplicable a un Préstamo Hipotecario Participado.	N/A
FECHA FINALIZACION	29/06/2036	29/06/2036

### CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

#### FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	TRIMESTRAL	
	15	ENERO ABRIL JULIO OCTUBRE
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)		
Anterior Fecha de Pago de Cupón	17/10/2016	
Anterior Fecha de Determinación	07/10/2016	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	16/01/2017	

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

	ÍNDICE DE REFERENCIA *	MARGEN	FECHA FIJACIÓN	VALOR ÍNDICE REFERENCIA	TIPO DE INTERÉS APLICABLE
TRAMO A2	EUR 3M	0,15 %	13/10/2016	-0,311 %	0,000%
TRAMO B	EUR 3M	0,22 %	13/10/2016	-0,311 %	0,000%
TRAMO C	EUR 3M	0,47 %	13/10/2016	-0,311 %	0,159%
TRAMO D	EUR 3M	2,25 %	13/10/2016	-0,311 %	1,939%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 3M	2,25 %	13/10/2016	-0,311 %	1,939%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN	EUR 3M	2,25 %	13/10/2016	-0,311 %	1,939%

\* Euribor 3M más un margen, fijado 2 Días Hábiles antes de la Anterior Fecha de Pago

#### INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI Original Legal Entity Identifier	95980020140005212957
--	----------------------

	BLOOMBERG TICKER
TRAMO A2	AYTGH 1X A2
TRAMO B	AYTGH 1X B
TRAMO C	AYTGH 1X C
TRAMO D	AYTGH 1X D

## CONTRAPARTIDAS

CONTRAPARTIDA	ENTIDAD	DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD
<i>Agente de Pagos</i>	<b>SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA</b>	<b>SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA</b>
<i>Depositario Cuenta Tesorería</i>	<b>SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA</b>	<b>SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA</b>
<i>Contrapartida Swap</i>	<b>BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA</b>	<b>BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA</b>
<i>Depositario Garantía Swap</i>	<b>SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA</b>	<b>SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA</b>
<i>Administrador</i>	<b>BARCLAYS BANK, S.A.</b>	<b>CAIXABANK, S.A.</b>
<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
Adecuación CS y AF a Criterios S&P 2010	05/07/2011	
Incorporación de Société Générale en sustitución de Barclays Bank SA como Agente Financiero	21/01/2015	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA
Establecimiento en SG Sucursal en España, depósito en garantía de las obligaciones de Barclays Bank PLC como CS de la operación.	09/07/2015	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA
Modificación Número de Cuenta de Tesorería y de la remuneración aplicable a la misma	20/05/2016	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA
Modificación Número de Cuenta de Garantías y de la remuneración aplicable a la misma	20/05/2016	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA

## RATING MÍNIMO CONTRAPARTIDAS EN DOCUMENTACIÓN

### AGENTE DE PAGOS / DEPOSITARIO CUENTA DE TESORERÍA

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
STANDARD & POORS	A	A-1	60	Naturales
FITCH	N/A	F1	60	Naturales
MOODY'S	N/A	P-1	60	Naturales

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA	STANDARD & POORS	A	A-1	NO	N/P
	FITCH	A	F1	NO	N/P
	MOODY'S	A2	P-1	NO	N/P

#### CONTRAPARTIDA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
STANDARD & POORS	A	A-1	10	Hábiles
CON COLATERAL	BBB+	N/A	60	Naturales
FITCH	A	F1	30	Naturales
CON COLATERAL	BBB+	F2	30	Naturales
MOODY'S	A2	P-1	30	Naturales
CON COLATERAL	A3	P-2	30	Naturales

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA	STANDARD & POORS			<b>NO *</b>	N/P
	CON COLATERAL	A-	A-2	NO	N/P
	FITCH			NO	N/P
	CON COLATERAL	A	F1	NO	N/P
	MOODY'S			NO	N/P
CON COLATERAL	A1	P-1	NO	N/P	

#### \* NOTAS

**S&P** : Se ha establecido un depósito en garantía de las obligaciones de la Entidad de Contrapartida de Swap

## DEPOSITARIO GARANTÍA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
STANDARD & POORS	A	A-1	N/A	N/A
FITCH	N/A	N/A	N/A	N/A
MOODY'S	N/A	N/A	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA	STANDARD & POORS	A	A-1	NO	N/P
	FITCH	A	F1	NO	N/P
	MOODY'S	A2	P-1	NO	N/P

## ADMINISTRADOR

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
STANDARD & POORS	N/A	A-1	N/A	N/A
FITCH	N/A	N/A	N/A	N/A
MOODY'S	N/A	N/A	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
CAIXABANK, S.A.	STANDARD & POORS	BBB	A-2	NO*	N/P
	FITCH	BBB	F2	NO	N/P
	MOODY'S	Baa2	P-2	NO	N/P

### \* NOTAS

**S&P** : La participación de Caixabank, S.A. como Administrador no tiene impacto negativo sobre las calificaciones otorgadas a los bonos, de forma que no es preciso llevar a cabo acciones correctivas

PROCESOS A EFECTUAR

[ACTUACIONES EN CAMINO](#)

SIN ACTUACIONES PENDIENTES