



AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A. - SERIE CAIXA GALICIA I -

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 | Se podrán realizar siempre que se mantenga la Entidad de Contrapartida inicial del Contrato de Swap, | N/A |
| FECHA FINALIZACION | 27/04/2058 | 27/04/2058 |

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

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

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 A | EUR 6M | 0,30 % | 13/01/2017 | -0,236 % | 0,064% |
| TRAMO B | EUR 6M | 0,60 % | 13/01/2017 | -0,236 % | 0,364% |
| TRAMO C | EUR 6M | 1,00 % | 13/01/2017 | -0,236 % | 0,764% |
| TRAMO D | EUR 6M | 2,00 % | 13/01/2017 | -0,236 % | 1,764% |
| PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA | EUR 6M | 2,00 % | 13/01/2017 | -0,236 % | 1,764% |
| PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN | EUR 6M | 2,00 % | 13/01/2017 | -0,236 % | 1,764% |

* Euribor 6M más un margen, fijado 2 Días Hábiles antes de la Anterior Fecha de Pago

INFORMACIÓN ADICIONAL

| | |
|--|----------------------|
| CÓDIGO LEI Original Legal Entity Identifier | 95980020140005216158 |
|--|----------------------|

| | BLOOMBERG TICKER |
|---------|------------------|
| TRAMO A | AYTCG 2008-CG1 A |
| TRAMO B | AYTCG 2008-CG1 B |
| TRAMO C | AYTCG 2008-CG1 C |
| TRAMO D | AYTCG 2008-CG1 D |

CONTRAPARTIDAS

| CONTRAPARTIDA | ENTIDAD | DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD |
|--|---|-----------------------------------|
| <i>Agente de Pagos</i> | BANCO SANTANDER, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. |
| <i>Depositario Cuenta Tesorería</i> | BANCO SANTANDER, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. |
| <i>Contrapartida Swap</i> | CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO | CECABANK, S.A. |
| <i>Depositario Garantía Swap</i> | BANCO SANTANDER, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. |
| <i>Administrador</i> | CAJA DE AHORROS DE GALICIA | ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A. |
| <i>Depositario Reserva Commingling</i> | BANCO SANTANDER, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. |
| <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 |
|--|------------|---|
| Establecimiento en CECA de un depósito en garantía de las obligaciones de Caixa Galicia como Entidad de Contrapartida de Swap. Dicha garantía está regulada en el Anexo III al CMOF formalizado en la misma fecha. | 17/04/2009 | CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO |
| Establecimiento en CECA de un depósito en garantía de las obligaciones de Caixa Galicia Administrador de los Activos. Dicha garantía vendrá definida por lo recogido en el Suplemento al Contrato de Admon formalizado en la misma fecha | 08/10/2010 | CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO |
| Modificación Escritura a los efectos de incorporar a Moodys como Agencia de Rating participe en la operación. Se modifican contrato swap, contrato admon, contrato prestación de servicios financieros | 20/12/2010 | |
| Subrogación de CECA en la posición de Caixa Galicia como Entidad de Contrapartida de Swap | 30/12/2010 | CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO |
| Establecimiento en CECA de un depósito en garantía de las obligaciones de CECA como Entidad de Contrapartida de Swap. | 02/04/2012 | CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO |
| Traslado Agente Financiero desde CECA a Barclays Bank PLC SE | 17/07/2012 | BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA |
| 2ª Modificación Escritura a los efectos de recoger criterios actualizados de las Agencias de Rating. Se ven afectados el Contrato de Swap, el Contrato de Prestación de Servicios Financieros y el Contrato de Admon | 27/07/2012 | |
| Traslado del Depósito en garantía de las obligaciones del Administrador desde CECA a Barclays Bank PLC SE | 02/08/2012 | BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA |
| Traslado del Depósito en garantía de las obligaciones de la Entidad de Contrapartida de Swap desde CECA a Barclays Bank PLC SE | 08/08/2012 | BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA |
| 3ª Modificación Escritura a los efectos de modificar las facultades de renegociación de los Activos por parte del Administrador a efectos de permitir la eliminación de la cláusula de suelo en los Préstamos Hipotecarios | 19/12/2013 | |
| Traslado Cuenta Tesorería a Barclays Bank (UK) | 08/05/2015 | BARCLAYS BANK PLC |
| Traslado Cuenta Depósito Swap a Barclays Bank (UK) | 08/05/2015 | BARCLAYS BANK PLC |
| ACCIÓN | FECHA | ENTIDAD DEPOSITARIA |

| | | |
|---|------------|-----------------------|
| Traslado Cuenta Depósito Administrador a Barclays Bank (UK) | 08/05/2015 | BARCLAYS BANK PLC |
| 4ª Escritura de Modificación de la Escritura de Constitución a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación por por por FITCH RATINGS ESPAÑA, S.A.U. ("FITCH") y MOODY'S INVESTORS SERVICE ESPAÑA, S.A. ("MOODY'S"), así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro, y otras modificaciones derivadas de la suscripción de un nuevo Contrato de Servicios Financieros | 16/03/2016 | |
| Traslado Agente Financiero desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A. | 16/03/2016 | BANCO SANTANDER, S.A. |
| Traslado depositaria cuenta de depósito en garantía de la CS desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A. | 16/03/2016 | BANCO SANTANDER, S.A. |
| Traslado depositaria cuenta de depósito en garantía del AD desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A. | 16/03/2016 | BANCO SANTANDER, S.A. |

RATING MÍNIMO CONTRAPARTIDAS EN DOCUMENTACIÓN

AGENTE DE PAGOS / DEPOSITARIO CUENTA DE TESORERÍA

| CONDICIONES DOCUMENTACIÓN | | | | |
|---------------------------|------------------------|-------------|-------------------|---------------------|
| AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
| | Largo plazo | Corto plazo | | |
| FITCH | A- | F2 | 30 | Naturales |
| MOODY'S | A3 | N/A | 30 | Naturales |

| RATING CONTRAPARTIDA | | | | | |
|-----------------------|-------------------------|------------------------|-------------|------------------|-------------------|
| ENTIDAD CONTRAPARTIDA | AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | TRIGGER ACTIVADO | PLAZO SUBSANACIÓN |
| | | Largo plazo | Corto plazo | | |
| BANCO SANTANDER, S.A. | FITCH | A- | F2 | NO | N/P |
| | MOODY'S | A3 | P-2 | NO | N/P |

CONTRAPARTIDA SWAP

| CONDICIONES DOCUMENTACIÓN | | | | |
|---------------------------|------------------------|-------------|-------------------|---------------------|
| AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
| | Largo plazo | Corto plazo | | |
| FITCH | A- | F2 | 30 | Naturales |
| CON COLATERAL | BBB- | F3 | 30 | Naturales |
| MOODY'S | N/A | N/A | | |
| CON COLATERAL | N/A | N/A | | |

| RATING CONTRAPARTIDA | | | | | |
|-----------------------|-------------------------|------------------------|-------------|------------------|-------------------|
| ENTIDAD CONTRAPARTIDA | AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | TRIGGER ACTIVADO | PLAZO SUBSANACIÓN |
| | | Largo plazo | Corto plazo | | |
| CECABANK, S.A. | FITCH | | | NO * | N/P |
| | CON COLATERAL | BBB- | F3 | NO | N/P |
| | MOODY'S | Baa2 | P-2 | NO | N/P |
| | CON COLATERAL | | | NO | N/P |

*** NOTAS**

FITCH : Se ha establecido un depósito en Banco Santander, en garantía de las obligaciones de CECABANK como Entidad de Contrapartida de Swap

MOODY'S: El establecimiento de un depósito por CECABANK supone que la participación de dicha Entidad como CS no tenga un impacto negativo sobre las calificaciones, por lo que el trigger no se ha detonado.

DEPOSITARIO GARANTÍA SWAP

| CONDICIONES DOCUMENTACIÓN | | | | |
|---------------------------|------------------------|-------------|-------------------|---------------------|
| AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
| | Largo plazo | Corto plazo | | |
| FITCH | A- | F2 | 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 | | |
| BANCO SANTANDER, S.A. | FITCH | A- | F2 | NO | N/P |
| | MOODY'S | A3 | P-2 | NO | N/P |

ADMINISTRADOR

| CONDICIONES DOCUMENTACIÓN | | | | |
|---------------------------|------------------------|-------------|-------------------|---------------------|
| AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
| | Largo plazo | Corto plazo | | |
| FITCH | N/A | F2 | 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 | | |
| ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A. | FITCH | BB+ | B | NO * | N/P |
| | MOODY'S | Ba1 | N/A | NO | N/P |

*** NOTAS**

FITCH : Se ha establecido un depósito según las directrices establecidas en documentación.

MOODY'S: Si bien no existe rating explícito el depósito anterior está siendo ajustado igualmente bajo los requisitos de Moody's.

No existe trigger para la entidad depositaria, la Entidad Depositaria actual dispone de calificación suficiente.

PROCESOS A EFECTUAR

[ACTUACIONES EN CAMINO](#)

SIN ACTUACIONES PENDIENTES