



AYT HIPOTECARIO MIXTO II, F.T.A. - SERIE CTH - 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	Los Administradores únicamente podrán acordar la modificación del tipo de interés de los Préstamos Hipotecarios a tipo de interés variable objeto de Certificados de Transmisión de Hipoteca cuando el margen medio ponderado de la cartera de Certificados de Transmisión de Hipoteca calculado sobre el índice de cada Préstamo Hipotecario en la Fecha de Cobro de que se trate, sea igual o superior a cuarenta y cinco (45) puntos básicos (0,45%).	0,467%
FECHA FINALIZACION	23/03/2034	23/03/2034

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	TRIMESTRAL	
	20	MARZO JUNIO SEPTIEMBRE DICIEMBRE
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)		
Anterior Fecha de Pago de Cupón	20/03/2020	
Anterior Fecha de Determinación	13/03/2020	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	22/06/2020	

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 CTH1	EUR 3M	0,18 %	18/03/2020	-0,408 %	0,000%
TRAMO CTH2	EUR 3M	0,95 %	18/03/2020	-0,408 %	0,542%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 3M	0,95 %	18/03/2020	-0,408 %	0,542%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN	AMORTIZADO	AMORTIZADO	AMORTIZADO	AMORTIZADO	AMORTIZADO

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

INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI Original Legal Entity Identifier	95980020140005215964
--	----------------------

	BLOOMBERG TICKER
TRAMO CTH1	AYTH M2 CH1
TRAMO CTH2	AYTH M2 CH2

CONTRAPARTIDAS

CONTRAPARTIDA	ENTIDAD	DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD
Agente de Pagos	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
Depositario Cuenta Tesorería	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
Contrapartida Swap	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA
Depositario Garantía Swap	NO APLICA	NO APLICA
Administrador	MULTICEDENTE	MULTICEDENTE
Administrador 1	CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	BANKIA, S.A.
Administrador 3	BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	BANKIA, S.A.
Depositario Reserva Commingling	MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE HUELVA Y SEVILLA	CAIXABANK, S.A.
Back up Servicer	NO APLICA	NO APLICA
Acreditante Línea Liquidez	NO APLICA	NO APLICA
Depositario Garantía Línea Liquidez	NO APLICA	NO APLICA
Avalista	NO APLICA	NO APLICA

ACCIONES CORRECTIVAS

CONCLUIDAS

ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
Apertura de cuenta en CECA en garantía de las obligaciones de la Contrapartida del Contrato de Swap	15/01/2008	Confederación Española de Cajas de Ahorros
Incorporación de JP Morgan como Entidad de Contrapartida de Swap en el lugar de Bearn Stearn	29/05/2009	
Apertura Cuenta Transitoria de Tesorería en Banco Santander, S.A.	13/04/2012	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado Agente Financiero desde CECA a Barclays Bank PLC SE	17/07/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
Traslado Cuenta Tesorería a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	
1ª 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 Moodys y Fitch, así como permitir que se apliquen criterios más actualizados que se publiquen en el futuro.	17/06/2016	
Incorporación de Banco Santander como Agente Financiero en sustitución de Barclays Bank PLC, Sucursal en España	17/06/2016	BANCO SANTANDER, S.A.

RATING MÍNIMO CONTRAPARTIDAS EN DOCUMENTACIÓN

AGENTE DE PAGOS / DEPOSITARIO CUENTA DE TESORERÍA

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		18/03/2020	-0,41%
	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	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		
FITCH	N/A	F1	30	Naturales
CON COLATERAL	N/A	N/A	30	Naturales
MOODY'S	A1	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		
J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	FITCH			NO	N/P
	CON COLATERAL	AA	F1+	NO	N/P
	MOODY'S			NO	N/P
	CON COLATERAL	Aa1	P-1	NO	N/P

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

SIN ACTUACIONES PENDIENTES