

HT ABANCA RMBS II, F.T.

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 margen medio resultante no fuera inferior a 65 puntos básicos, bonificaciones incluidas	0,827%
FECHA FINALIZACION	30/12/2057	30/12/2057

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	TRIMESTRAL	
	25	ENERO ABRIL JULIO OCTUBRE
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)		

Anterior Fecha de Pago de Cupón	26/07/2022	
Anterior Fecha de Determinación	14/07/2022	7 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	25/10/2022	

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 ÚNICO	EUR 3M	0,30 %	21/07/2022	0,145 %	0,445%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 3M	0,65 %	21/07/2022	0,145 %	0,795%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS INICIALES	EUR 3M	0,65 %	21/07/2022	0,145 %	0,795%

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

INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI Original Legal Entity Identifier	9598003B8B7BNRUKZG55
--	----------------------

	BLOOMBERG TICKER
TRAMO ÚNICO	

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	NO APLICA	NO APLICA
Depositario Garantía Swap	NO APLICA	NO APLICA
Administrador	ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.	ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.
Depositario Reserva Commingling	NO APLICA	NO APLICA
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
N/P		

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		
SCOPE RATING AG	A-	N/A	60	Naturales
FITCH	A-	F2	30	Naturales
DBRS	A	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.	SCOPE RATING AG	AA-	S-1+	NO	N/P
	FITCH	A	F1	NO	N/P
	DBRS	A (high)	R-1 (middle)	NO	N/P

ADMINISTRADOR

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	A-	F2	N/A	N/A
SCOPE RATING AG	BBB	S-2	30	Naturales
DBRS	BBB (Low)	N/A	30	Naturales

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.	FITCH	A-	F2	NO	N/P
	SCOPE RATING AG	AA-	S-1+	NO	N/P
	DBRS	BBB (high)	R-1 (Low)	NO	N/P

* NOTAS
<i>DBRS: Trigger no detonado. La valoración interna realizada por DBRS a ABANCA CORPORACIÓN BANCARIA, indica que su rating es superior al establecido como "trigger".</i>

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

SIN ACTUACIONES PENDIENTES