

**AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A.  
- SERIE CAJA CANTABRIA 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	Las modificaciones en el tipo de interés, se podrán realizar siempre que se mantenga la contrapartida inicial del Contrato de Swap, de acuerdo con lo previsto tanto en la Escritura de Constitución como en el Folleto	N/A
FECHA FINALIZACION	20/03/2048	20/03/2048

**CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN**

**FECHAS DE PAGO**

Frecuencia de pago de cupón	TRIMESTRAL	
	20	MARZO SEPTIEMBRE
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)		
Anterior Fecha de Pago de Cupón	20/09/2022	
Anterior Fecha de Determinación	13/09/2022	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	21/03/2023	

**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	EUR 6M	0,30 %	16/09/2022	1,672 %	1,972%
TRAMO B	EUR 6M	0,60 %	16/09/2022	1,672 %	2,272%
TRAMO C	EUR 6M	1,00 %	16/09/2022	1,672 %	2,672%
TRAMO D	EUR 6M	2,00 %	16/09/2022	1,672 %	3,672%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 6M	2,00 %	16/09/2022	1,672 %	3,672%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 6M	2,00 %	16/09/2022	1,672 %	3,672%

\* 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-CC1 A
TRAMO B	AYTCG 2008-CC1 B
TRAMO C	AYTCG 2008-CC1 C
TRAMO D	AYTCG 2008-CC1 D

## 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	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO	CECABANK, S.A.
Depositario Garantía Swap	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
Administrador	CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	UNICAJA BANCO, S.A.
Depositario Reserva Commingling	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, 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
Escritura de Modificación con objeto de incorporar a Moodys como Agencia de Calificación.	01/03/2011	
Establecimiento en CECA de un depósito en garantía de las obligaciones de CECA como CS	02/04/2012	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Apertura Cuenta de Tesorería (transitoria) en Banco Santander.	13/04/2012	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado depósito en garantía de las obligaciones de CECA como CS desde CECA a BBPLC SE	08/08/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
2ª Escritura de modificación el objeto de: (i) sustituir a CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORROS por BANCO SANTANDER, S.A. como Agente Financiero por descenso de su calificación crediticia y (ii) modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero y la Entidad de Contrapartida del Contrato de Swap en caso de descenso de su calificación por MOODY'S INVESTORS SERVICE ESPAÑA, S.A. ("MOODY'S") y FITCH RATINGS ESPAÑA, S.A.U. ("FITCH"), así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro	09/08/2012	BANCO SANTANDER, S.A.
Formalización Suplemento al Contrato de Administración y Establecimiento en Banco Santander de un depósito en garantía de las obligaciones de Caja Cantabria (LIBERBANK) como Administrador de los Activos	15/04/2013	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado Cuenta Depósito Swap a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	
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.

13/03/2020  
21/09/2020

## 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	BBB+	F2	30	Naturales
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	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	BBB+	F2	30	Naturales
CON COLATERAL	BB+	N/A	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			NO	N/P
	CON COLATERAL	Baa1	P-2	NO	N/P

#### \* NOTAS

**FITCH** : Se ha establecido un depósito en garantía de las obligaciones de la Entidad de Contrapartida de Swap, siguiendo las especificaciones recogidas en documentación.

**MOODY'S**: El establecimiento de un depósito supone que la participación de dicha Entidad de Contrapartida no tenga 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	BBB+	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	N/A	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		
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		
UNICAJA BANCO, S.A.	FITCH	BBB-	F3	NO	N/P
	MOODY'S	Baa3	P-3	NO	N/P

### \* NOTAS

**FITCH** : Se ha establecido un depósito en garantía de las obligaciones de la Entidad Administradora, siguiendo las especificaciones recogidas en documentación.

**MOODY'S**: Si bien no existe rating explícito depósito en garantía de las obligaciones de la Entidad Administradora, 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