



## AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A. - SERIE CCM 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                                                                                                                                                                                                | LÍMITE ACTUAL                       |
| NOVACIONES DE TIPO DE INTERÉS | 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<br>No hay contrapartida de swap |
| FECHA FINALIZACIÓN            | 27/11/2047                                                                                                                                                                                                              | 27/11/2047                          |

#### CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

##### FECHAS DE PAGO

| Frecuencia de pago de cupón                     | TRIMESTRAL |                                          |
|-------------------------------------------------|------------|------------------------------------------|
|                                                 | 28         | MAYO<br>NOVIEMBRE                        |
| Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil) |            |                                          |
| Anterior Fecha de Pago de Cupón                 | 28/11/2019 | 5 días hábiles antes de la Fecha de Pago |
| Anterior Fecha de Determinación                 | 21/11/2019 |                                          |
| Próxima Fecha de Pago                           | 28/05/2020 |                                          |

##### 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                                  | FIJO                   | 0,00 % | N/A            | N/A                     | 1,300%                    |
| TRAMO B                                  | FIJO                   | 0,00 % | N/A            | N/A                     | 1,600%                    |
| TRAMO C                                  | FIJO                   | 0,00 % | N/A            | N/A                     | 2,000%                    |
| TRAMO D                                  | FIJO                   | 0,00 % | N/A            | N/A                     | 3,000%                    |
| PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA    | EUR 6M                 | 2,00 % | 24/05/2019     | -0,338 %                | 1,662%                    |
| PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN | EUR 6M                 | 2,00 % | 24/05/2019     | -0,338 %                | 1,662%                    |

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

##### INFORMACIÓN ADICIONAL

|                                                |                      |
|------------------------------------------------|----------------------|
| CÓDIGO LEI<br>Original Legal Entity Identifier | 95980020140005216158 |
|------------------------------------------------|----------------------|

|         | BLOOMBERG TICKER  |
|---------|-------------------|
| TRAMO A | AYTCG 2007-CCM1 A |
| TRAMO B | AYTCG 2007-CCM1 B |
| TRAMO C | AYTCG 2007-CCM1 C |
| TRAMO D | AYTCG 2007-CCM1 D |

## CONTRAPARTIDAS

| CONTRAPARTIDA                       | ENTIDAD                               | DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD       |
|-------------------------------------|---------------------------------------|-----------------------------------|
| Agente de Pagos                     | BANCO SANTANDER, S.A.                 | BANCO SANTANDER, S.A.             |
| Depositorio Cuenta Tesorería        | BANCO SANTANDER, S.A.                 | BANCO SANTANDER, S.A.             |
| Contrapartida Swap                  | NO APLICA                             | NO APLICA                         |
| Depositorio Garantía Swap           | NO APLICA                             | NO APLICA                         |
| Administrador                       | CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA | BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A. |
| Depositorio Reserva Commingling     | BANCO SANTANDER, S.A.                 | BANCO SANTANDER, S.A.             |
| Back up Servicer                    | NO APLICA                             | NO APLICA                         |
| Acreditante Línea Liquidez          | NO APLICA                             | NO APLICA                         |
| Depositorio Garantía Línea Liquidez | NO APLICA                             | NO APLICA                         |
| Avalista                            | NO APLICA                             | NO APLICA                         |

## ACCIONES CORRECTIVAS

### CONCLUIDAS

| ACCIÓN                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | FECHA      | ENTIDAD DEPOSITARIA                       |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|-------------------------------------------|
| Establecimiento en CECA de un depósito en garantía de las obligaciones de CECA como Entidad de Contrapartida de Swap                                                                                                                                                                                    | 23/11/2011 | CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO |
| Novación del contrato de Depósito en garantía de las obligaciones de CECA como CS                                                                                                                                                                                                                       | 02/04/2012 |                                           |
| Apertura cuenta de tesorería transitoria en Banco Santander, S.A.                                                                                                                                                                                                                                       | 13/04/2012 | BANCO SANTANDER, S.A.                     |
| Traspaso Agente Financiero desde CECA a Banco Santander                                                                                                                                                                                                                                                 | 18/09/2012 | BANCO SANTANDER, S.A.                     |
| Traspaso Contrapartida SWAP desde CECA a Banco Castilla la Mancha                                                                                                                                                                                                                                       | 18/09/2012 | BANCO DE CASTILLA LA MANCHA, S.A.         |
| 2ª Modificación Escritura. Limitación rating Fitch A+ y rating S&P limitado a efectos CS                                                                                                                                                                                                                | 18/09/2012 |                                           |
| Establecimiento de un depósito en Banco Santander, en garantía de las obligaciones de Banco Castilla la Mancha como Administrador de los Activos.                                                                                                                                                       | 17/01/2013 | BANCO SANTANDER, S.A.                     |
| Modificación de Escritura a los efectos de convertir el Tipo de Interés aplicable a los Bonos de la Serie a tipo fijo, eliminar de la estructura de los Bonos de la Serie el Contrato de Swap, modificar la forma de cálculo del importe de depósito en garantía de las obligaciones del Administrador. | 08/04/2013 |                                           |

## 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 |                   |                     |
| STANDARD & POORS          | A                      | A-1         | 60                | Naturales           |
| FITCH                     | BBB+                   | F2          | 30                | Naturales           |

| RATING CONTRAPARTIDA  |                         |                        |             |                  |                   |
|-----------------------|-------------------------|------------------------|-------------|------------------|-------------------|
| ENTIDAD CONTRAPARTIDA | AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE |             | TRIGGER ACTIVADO | PLAZO SUBSANACIÓN |
|                       |                         | Largo plazo            | Corto plazo |                  |                   |
| BANCO SANTANDER, S.A. | STANDARD & POORS        | A                      | A-1         | NO               | N/P               |
|                       | FITCH                   | A                      | F1          | NO               | N/P               |

#### ADMINISTRADOR

| CONDICIONES DOCUMENTACIÓN |                        |             |                   |                     |
|---------------------------|------------------------|-------------|-------------------|---------------------|
| AGENCIA DE CALIFICACIÓN   | RATING MINIMO EXIGIBLE |             | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
|                           | Largo plazo            | Corto plazo |                   |                     |
| STANDARD & POORS          | N/A                    | N/A         | N/A               | N/A                 |
| FITCH                     | BBB+                   | F2          | 30                | Naturales           |

| RATING CONTRAPARTIDA              |                         |                        |             |                  |                   |
|-----------------------------------|-------------------------|------------------------|-------------|------------------|-------------------|
| ENTIDAD CONTRAPARTIDA             | AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE |             | TRIGGER ACTIVADO | PLAZO SUBSANACIÓN |
|                                   |                         | Largo plazo            | Corto plazo |                  |                   |
| BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A. | STANDARD & POORS        | N/A                    | N/A         | NO               | N/P               |
|                                   | FITCH                   | N/A                    | N/A         | NO               | N/P               |

| * NOTAS                                                                                                                        |  |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
| <b>FITCH:</b> Establecido Depósito en garantía de las obligaciones del Administrador, que provoca que el trigger no se detone. |  |

#### DEPÓSITO COMMINGLING

| CONDICIONES DOCUMENTACIÓN |                        |             |                   |                     |
|---------------------------|------------------------|-------------|-------------------|---------------------|
| AGENCIA DE CALIFICACIÓN   | RATING MINIMO EXIGIBLE |             | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
|                           | Largo plazo            | Corto plazo |                   |                     |
| STANDARD & POORS          | N/A                    | N/A         | N/A               | N/A                 |
| FITCH                     | BBB+                   | F2          | 30                | Naturales           |

| RATING CONTRAPARTIDA  |                         |                        |             |                  |                   |
|-----------------------|-------------------------|------------------------|-------------|------------------|-------------------|
| ENTIDAD CONTRAPARTIDA | AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE |             | TRIGGER ACTIVADO | PLAZO SUBSANACIÓN |
|                       |                         | Largo plazo            | Corto plazo |                  |                   |
| BANCO SANTANDER, S.A. | STANDARD & POORS        | A                      | A-1         | NO               | N/P               |
|                       | FITCH                   | A                      | F1          | NO               | N/P               |

#### PROCESOS A EFECTUAR

##### ACTUACIONES EN CAMINO

SIN ACTUACIONES PENDIENTES