



# AYT DEUDA SUBORDINADA I, F.T.A.

## 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 INTERÉS	N/A	N/A
FECHA FINALIZACION	17/11/2016	17/11/2019

### CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

#### FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	TRIMESTRAL	
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)	26	FEBRERO MAYO AGOSTO NOVIEMBRE
Anterior Fecha de Pago de Cupón	12/02/2018	
Anterior Fecha de Determinación	-	9 días naturales antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	N/A	

#### 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 3M	0,20 %	NA	NA	NA
TRAMO B	EUR 3M	0,40 %	NA	NA	NA
TRAMO C	EUR 3M	0,65 %	NA	NA	NA
CRÉDITO SUBORDINADO	EUR 3M	1,50 %	NA	NA	NA

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

#### INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI Original Legal Entity Identifier	9598006Q5SRJ7TU3PD53
--	----------------------

**FONDO EN LIQUIDACIÓN**

## CONTRAPARTIDAS

CONTRAPARTIDA	ENTIDAD	DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD
Agente de Pagos	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORROS	CECABANK, S.A.
Depositorio Cuenta Tesorería	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORROS	CECABANK, S.A.
Contrapartida Swap	NO APLICA	NO APLICA
Depositorio Garantía Swap	NO APLICA	NO APLICA
Administrador	HAYA TITULIZACIÓN, S.G.F.T., S.A.U.	HAYA TITULIZACIÓN, S.G.F.T., S.A.U.
Depositorio Reserva Commingling	NO APLICA	NO APLICA
Back up Servicer	NO APLICA	NO APLICA
Acreditante Línea Liquidez	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORROS	CECABANK, S.A.
Depositorio Garantía Línea Liquidez	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORROS	CECABANK, S.A.
Avalista	NO APLICA	NO APLICA

## ACCIONES CORRECTIVAS

### CONCLUIDAS

ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
Disposición en el Agente Financiero del importe correspondiente al importe de la Línea de Liquidez	24/02/2012	CECABANK, S.A.

## RATING MÍNIMO CONTRAPARTIDAS EN DOCUMENTACIÓN

### AGENTE DE PAGOS / DEPOSITARIO CUENTAS

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
STANDARD & POORS	CC	N/A	30	Naturales
FITCH	N/A	F1	30	Naturales

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
CECABANK, S.A.	STANDARD & POORS	BBB	A-2	NO	N/P
	FITCH	BBB-	F3	NO*	N/P

**\* NOTAS**

**FITCH:** La calificación de CECABANK es superior a la calificación otorgada a los bonos, de forma que su permanencia como Agente Financiero no tiene impacto.

**ACREDITANTE LÍNEA DE LIQUIDEZ**

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
STANDARD & POORS	CC	N/A	2	Hábiles
FITCH	N/A	F1	2	Hábiles

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
CECABANK, S.A.	STANDARD & POORS	BBB	A-2	NO	N/P
	FITCH	BBB-	F3	NO*	N/P

**\* NOTAS**

**FITCH:** Se ha procedido con la disposición completa del Crédito Subordinado.

**PROCESOS A EFECTUAR**

**ACTUACIONES EN CAMINO**

SIN ACTUACIONES PENDIENTES