



# AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A. - SERIE SA NOSTRA 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	Se podrán realizar siempre que se mantenga la Entidad de Contrapartida inicial del Contrato de Swap,	N/A
FECHA FINALIZACION	16/05/2047	16/05/2047

### CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

#### FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	SEMESTRAL	
	16	MAYO NOVIEMBRE
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)		

Anterior Fecha de Pago de Cupón	16/05/2018	
Anterior Fecha de Determinación	08/05/2018	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	16/11/2018	

#### 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	EUR 6M	0,17 %	11/05/2018	-0,271 %	0,000%
TRAMO B	EUR 6M	0,30 %	11/05/2018	-0,271 %	0,029%
TRAMO C	EUR 6M	0,65 %	11/05/2018	-0,271 %	0,379%
TRAMO D	EUR 6M	2,00 %	11/05/2018	-0,271 %	1,729%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 6M	2,00 %	11/05/2018	-0,271 %	1,729%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN	AMORTIZADO	AMORTIZADO	AMORTIZADO	AMORTIZADO	AMORTIZADO

\* 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 07-SAN1 A
TRAMO B	AYTCG 07-SAN1 B
TRAMO C	AYTCG 07-SAN1 C
TRAMO D	AYTCG 07-SAN1 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 Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	BANCO MARE NOSTRUM, 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
Establecimiento de una Garantía Financiera Pignoratícia en garantía de las obligaciones de Sa Nostra como Administrador de los Activos.	10/02/2010	
Modificación de Escritura a los efectos de incorporar a S&P como Entidad de Calificación. Modificación Contrato Prestación de Servicios Financieros y Formalización Anexo III, y Modificación Anexo I.	18/02/2011	
Establecimiento en CECA de un depósito en garantía de las obligaciones de CECA como CS	23/11/2011	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Modificación Contrato depósito Garantía Swap en CECA	02/04/2012	
Establecimiento Cuenta de Tesorería transitoria en Banco Santander	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
Apertura Cuenta de Depósito en Barclays Bank PLC SE en garantía de las obligaciones del Administrador	02/08/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
2ª Modificación escritura a los efectos de 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 S&P y FITCH, así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro. Se ven afectados los contratos de Prestación de Servicios Financieros y Swap.	09/08/2012	
Traslado depósito a BBPLC SE del depósito en garantía de las obligaciones de la Contrapartida de Swap	12/02/2013	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
Traslado Cuenta Tesorería a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
Traslado Cuenta Depósito Swap a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
Traslado Cuenta Depósito Administrador a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
2ª Escritura de 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 FITCH RATINGS ESPAÑA, S.A.U. ("FITCH") y STANDARD & POOR'S CREDIT MARKET SERVICES EUROPE LIMITED ("STANDARD & POOR'S" o "S&P"), así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro, y otras modificaciones derivadas de la suscripción de un nuevo Contrato de Servicios Financieros.	16/03/2016	

ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
Traslado Agente Financiero desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado depositaría cuenta de depósito en garantía de la CS desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado depositaría cuenta de depósito en garantía del AD desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.

## 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	BBB-	N/A	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

### CONTRAPARTIDA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
STANDARD & POORS	BBB	N/A	N/A	N/A
CON COLATERAL	BBB-	N/A	N/A	N/A
FITCH	A-	F2	N/A	N/A
CON COLATERAL	BBB-	F3	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.	STANDARD & POORS	BBB	A-2	NO	N/P
	CON COLATERAL			NO	N/P
	FITCH	BBB-	F3	NO *	N/P
	CON COLATERAL			NO	N/P

**\* NOTAS**

**S&P** : Conforme recogido en documentación, el trigger se detonará en caso de que el mantenimiento de CECABANK suponga que los Bonos no puedan mantener la calificación A-. Confirmación de S&P de que la operación sin swap puede mantener dicha calificación.

**FITCH**: Se ha establecido un depósito en Banco Santander, en garantía de las obligaciones de CECABANK como Entidad de Contrapartida de Swap

**DEPOSITARIO GARANTÍA SWAP**

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	A-	F2	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.	STANDARD & POORS	A	A-1	NO	N/P
	FITCH	A	F1	NO	N/P

**\* NOTAS**

Existe una cuenta abierta para regular el potencial establecimiento de un depósito en garantía del Administrador.

Actualmente no es necesario proceder con un depósito, y por lo tanto, la cuenta, aunque abierta, no está siendo utilizada. No hay trigger explícito para el Administrador

**PROCESOS A EFECTUAR**

**ACTUACIONES EN CAMINO**

SIN ACTUACIONES PENDIENTES