

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 | 0,828% |
| FECHA FINALIZACION | 30/12/2057 | 30/12/2057 |

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

| Frecuencia de pago de cupón | TRIMESTRAL | |
|-----------------------------|---|----|
| | Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil) | 25 |

| | | |
|---------------------------------|------------|--|
| Anterior Fecha de Pago de Cupón | 25/10/2021 | |
| Anterior Fecha de Determinación | 18/10/2021 | 7 días hábiles antes de la Fecha de Pago |
| Próxima Fecha de Pago | 25/01/2022 | |

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 % | 21/10/2021 | -0,548 % | 0,000% |
| PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA | EUR 3M | 0,65 % | 21/10/2021 | -0,548 % | 0,102% |
| PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS INICIALES | EUR 3M | 0,65 % | 21/10/2021 | -0,548 % | 0,102% |

* 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 MÍNIMO EXIGIBLE | | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
| | Largo plazo | Corto plazo | | |
| SCOPE RATING AG | A- | N/A | 30 | Naturales |
| FITCH | A- | F2 | 60 | Naturales |
| DBRS | A | N/A | 30 | Naturales |

| RATING CONTRAPARTIDA | | | | | |
|-----------------------|-------------------------|------------------------|--------------|------------------|-------------------|
| ENTIDAD CONTRAPARTIDA | AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MÍNIMO 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 | R-2 (High) | NO | N/P |

* NOTAS

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

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

SIN ACTUACIONES PENDIENTES