



# AYT GÉNOVA HIPOTECARIO XI, F.T.H.

## 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 INTERES	El Administrador no podrá, en ningún caso (ni siquiera a instancias de la Sociedad Gestora), entablar renegociaciones de tipo de interés que puedan resultar en una disminución del tipo de interés aplicable a un Préstamo Hipotecario Participado.	N/A
FECHA FINALIZACION	25/09/2037	25/09/2037

### CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

#### FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	TRIMESTRAL	
	15	FEBRERO MAYO AGOSTO NOVIEMBRE
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)		
Anterior Fecha de Pago de Cupón	17/02/2020	
Anterior Fecha de Determinación	10/02/2020	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	18/05/2020	

#### 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 A2	EUR 3M	0,20 %	13/02/2020	-0,411 %	0,000%
TRAMO B	EUR 3M	0,30 %	13/02/2020	-0,411 %	0,000%
TRAMO C	EUR 3M	0,60 %	13/02/2020	-0,411 %	0,189%
TRAMO D	EUR 3M	2,50 %	13/02/2020	-0,411 %	2,089%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 3M	2,50 %	13/02/2020	-0,411 %	2,089%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN	EUR 3M	2,50 %	13/02/2020	-0,411 %	2,089%

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

#### INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI Original Legal Entity Identifier	95980020140005209950
------------------------------------------------	----------------------

	BLOOMBERG TICKER
TRAMO A2	AYT GHXI A2
TRAMO B	AYT GHXI B
TRAMO C	AYT GHXI C
TRAMO D	AYT GHXI D

## CONTRAPARTIDAS

CONTRAPARTIDA	ENTIDAD	DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD
<i>Agente de Pagos</i>	CAIXABANK, S.A.	CAIXABANK, S.A.
<i>Depositario Cuenta Tesorería</i>	CAIXABANK, S.A.	CAIXABANK, S.A.
<i>Contrapartida Swap</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Depositario Garantía Swap</i>	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA
<i>Administrador</i>	BARCLAYS BANK, S.A.	CAIXABANK, S.A.
<i>Depositario Reserva Commingling</i>	NO APLICA	NO APLICA
<i>Back up Servicer</i>	NO APLICA	NO APLICA
<i>Acreditante Línea Liquidez</i>	NO APLICA	NO APLICA
<i>Depositario Garantía Línea Liquidez</i>	NO APLICA	NO APLICA
<i>Avalista</i>	NO APLICA	NO APLICA

## ACCIONES CORRECTIVAS

### CONCLUIDAS

ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
Adecuación CS y AF a Criterios S&P 2010	05/07/2011	
2ª Modificación de la Escritura de Constitución a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero y el Administrador en caso de descenso de su calificación por FITCH y STANDARD & POOR'S	23/01/2015	
Cambio denominación Cuenta de Tesorería como consecuencia de la absorción de Barclays Bank SA por parte de Caixabank	18/05/2015	CAIXABANK, S.A.
Establecimiento en SG Sucursal en España, depósito en garantía de las obligaciones de Barclays Bank PLC como CS de la operación.	09/07/2015	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA
Modificación Número de Cuenta de Garantías y de la remuneración aplicable a la misma	20/05/2016	
3ª Escritura de Modificación, a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por la Parte B del Contrato de Permuta Financiera de Intereses en caso de descenso de su calificación por FITCH y S&P, así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro.	21/12/2016	
Incorporación de Banco Santander en sustitución de Barclays Bank PLC, como Parte B del Contrato de Permuta Financiera de Intereses	21/12/2016	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	60	Naturales

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
CAIXABANK, S.A.	STANDARD & POORS	BBB+	A-2	NO	N/P
	FITCH	BBB+	F2	NO	N/P

#### \* NOTAS

**FITCH** : El rating de el Agente de Pagos es suficiente para que los bonos alcancen una calificación "A-".

### CONTRAPARTIDA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
STANDARD & POORS	BBB	N/A	10	Hábiles
CON COLATERAL	BBB-	N/A	60	Naturales
FITCH	BBB	F2	14	Naturales
CON COLATERAL	BB+	N/A	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
	CON COLATERAL			NO	N/P
	FITCH	A	F1	NO	N/P
	CON COLATERAL			NO	N/P

## DEPOSITARIO GARANTÍA 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
FITCH	BBB+	F2	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA	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	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
CAIXABANK, S.A.	STANDARD & POORS	BBB+	A-2	NO	N/P
	FITCH	BBB+	F2	NO	N/P

## PROCESOS A EFECTUAR

### ACTUACIONES EN CAMINO

SIN ACTUACIONES PENDIENTES