



# AYT HIPOTECARIO III, 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	Los Administradores estarán obligados a abonar al Fondo la diferencia entre (a) los intereses devengados por el Préstamo Hipotecario Participado desde la última Fecha de Cobro y (b) los intereses que hubiera devengado el Préstamo Hipotecario Participado, cuando el margen medio ponderado de la cartera sobre el tipo de interés de referencia para los Bonos sea igual o inferior a 0,90% e igual o superior a 0,70%. Por debajo de 0,70% no estarían permitidas y por encima de 0,90% no habrá lugar a compensación alguna.	0,695%
FECHA FINALIZACION	18/03/2033	18/03/2033

### CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

#### FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	TRIMESTRAL	
	18	MARZO JUNIO SEPTIEMBRE DICIEMBRE
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)		
Anterior Fecha de Pago de Cupón	19/06/2017	
Anterior Fecha de Determinación	12/06/2017	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	18/09/2017	

#### 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 3M	0,27 %	15/06/2017	-0,329 %	0,000%
TRAMO B	EUR 3M	0,65 %	15/06/2017	-0,329 %	0,321%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 3M	0,65 %	15/06/2017	-0,329 %	0,321%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN	NA	NA	NA	NA	NA

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

#### INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI Original Legal Entity Identifier	9598009MLQ3KQ2ADEM12
	BLOOMBERG TICKER
TRAMO A	AYTH III A
TRAMO B	AYTH III B

## 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	MULTICEDENTE	MULTICEDENTE
Administrador 1	CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	CAIXABANK, S.A.
Administrador 2	CAJA RURAL INTERMEDITERRÁNEA, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CRÉDITO	CAJA RURAL INTERMEDITERRÁNEA, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CRÉDITO
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
Traslado Agente Financiero desde CECA a Barclays Bank PLC SE	17/07/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
Traslado Cuenta Tesorería a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
1ª 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 Moodys, así como permitir que se apliquen criterios más actualizados que se publiquen en el futuro.	03/06/2016	
Incorporación de Banco Santander como Agente Financiero en sustitución de Barclays Bank PLC, Sucursal en España	03/06/2016	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		
MOODY'S	A3	N/A	30	Hábiles

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO SANTANDER, S.A.	MOODY'S	A3	P-2	NO	N/P

### PROCESOS A EFECTUAR

#### ACTUACIONES EN CAMINO

SIN ACTUACIONES PENDIENTES