



CAJA INGENIEROS AYT2, 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 INTERES | Autorizadas si el nuevo margen medio ponderado de los préstamos no es inferior en más del 15% al margen medio ponderado de los préstamos en la fecha de constitución. | 0,54%>0,54% |
| FECHA FINALIZACION | 25/05/2051 | 25/05/2051 |

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

| Frecuencia de pago de cupón | TRIMESTRAL | |
|---|------------|--|
| | 25 | FEBRERO MAYO AGOSTO NOVIEMBRE |
| Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil) | | |
| Anterior Fecha de Pago de Cupón | 25/05/2021 | |
| Anterior Fecha de Determinación | 18/05/2021 | 5 días hábiles antes de la Fecha de Pago |
| Próxima Fecha de Pago | 25/08/2021 | |

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 | 0,30 % | 21/05/2021 | -0,543 % | 0,000% |
| TRAMO B | EUR 3M | 0,75 % | 21/05/2021 | -0,543 % | 0,207% |
| PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA | EUR 3M | 0,00 % | 21/05/2021 | -0,543 % | 0,000% |
| PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN | AMORTIZADO | AMORTIZADO | AMORTIZADO | AMORTIZADO | AMORTIZADO |

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

INFORMACIÓN ADICIONAL

| | |
|--|----------------------|
| CÓDIGO LEI Original Legal Entity Identifier | 95980058D53QTFPZS539 |
|--|----------------------|

| | BLOOMBERG TICKER |
|---------|------------------|
| TRAMO A | CAING 2012-1 A |
| TRAMO B | CAING 2012-1 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 | CAIXA DE CREDIT DELS ENGINYERS- CAJA DE CREDITO DE LOS INGENIEROS, S. COOP. DE CREDITO | CAIXA DE CREDIT DELS ENGINYERS- CAJA DE CREDITO DE LOS INGENIEROS, S. COOP. DE CREDITO |
| Depositario Reserva Commingling | BANCO SANTANDER, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. |
| Back up Servicer | BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A. | BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A. |
| 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 ICO a Barclays Bank PLC SE | 10/12/2012 | BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA |
| Trapaso depósito en garantía de las obligaciones del Administrador desde ICO a Barclays Bank PLC SE | 10/12/2012 | BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA |
| Traslado Cuenta Tesorería a Barclays Bank (UK) | 08/05/2015 | |
| Traslado Cuenta Depósito Administrador a Barclays Bank (UK) | 08/05/2015 | |
| 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 y Fitch, 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. |
| Traslado Cuenta Depósito Administrador desde Barclays Bank PLC a Banco Santander, S.A. | 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 MÍNIMO EXIGIBLE | | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
| | Largo plazo | Corto plazo | | |
| FITCH | A- | F2 | 30 | Naturales |
| MOODY'S | A3 | 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. | FITCH | A | F1 | NO | N/P |
| | MOODY'S | A2 | P-1 | NO | N/P |

ADMINISTRADOR

| CONDICIONES DOCUMENTACIÓN | | | | |
|---------------------------|------------------------|-------------|-------------------|---------------------|
| AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
| | Largo plazo | Corto plazo | | |
| FITCH | A | F1 | 14 | Naturales |
| MOODY'S | N/A | N/A | N/A | N/A |

| RATING CONTRAPARTIDA | | | | | |
|--|-------------------------|------------------------|-------------|------------------|-------------------|
| ENTIDAD CONTRAPARTIDA | AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | TRIGGER ACTIVADO | PLAZO SUBSANACIÓN |
| | | Largo plazo | Corto plazo | | |
| CAIXA DE CREDIT DELS ENGINYERS- CAJA DE CREDITO DE LOS INGENIEROS, S. COOP. DE CREDITO | FITCH | N/A | N/A | NO * | N/P |
| | MOODY'S | N/A | N/A | NO | N/P |

* NOTAS

Desde la constitución del Fondo se estableció BACK-UP SERVICER, así como el depósito en garantía de las obligaciones la Entidad Administradora

DEPOSITO COMMINGLING

| CONDICIONES DOCUMENTACIÓN | | | | |
|---------------------------|------------------------|-------------|-------------------|---------------------|
| AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
| | Largo plazo | Corto plazo | | |
| FITCH | A | F1 | N/A | N/A |
| MOODY'S | N/A | N/A | 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. | FITCH | A | F1 | NO * | N/P |
| | MOODY'S | A2 | P-1 | NO | N/P |

* NOTAS

FITCH: El depósito debe establecerse en el Agente Financiero.

La participación de Banco Santander, S.A., como Entidad Depositaria no tiene impacto sobre la calificación otorgada a los bonos.

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

SIN ACTUACIONES PENDIENTES