

AYT GOYA HIPOTECARIO V, 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 | No se podrá renegociar el margen del tipo de interés de ningún Préstamo Hipotecario de manera que el margen resultante no se sitúe por debajo de 35 puntos básicos (0,35%) | 0,350% |
| FECHA FINALIZACION | 15/03/2050 | 15/03/2050 |

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

| Frecuencia de pago de cupón | SEMESTRAL | |
|---|-----------|---------------------|
| | 15 | MARZO SEPTIEMBRE |
| Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil) | | |

| | | |
|---------------------------------|------------|--|
| Anterior Fecha de Pago de Cupón | 15/09/2022 | |
| Anterior Fecha de Determinación | 08/09/2022 | 5 días hábiles antes de la Fecha de Pago |
| Próxima Fecha de Pago | 15/03/2023 | |

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 6M | 0,30 % | 13/09/2022 | 1,538 % | 1,838% |
| TRAMO B | EUR 6M | 0,60 % | 13/09/2022 | 1,538 % | 2,138% |
| PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA | EUR 6M | 0,60 % | 13/09/2022 | 1,538 % | 2,138% |
| PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN | EUR 6M | 0,60 % | 13/09/2022 | 1,538 % | 2,138% |

* Euribor 6M más un margen, fijado 2 Días Hábiles antes de la Anterior Fecha de Pago

INFORMACIÓN ADICIONAL

| | |
|--|----------------------|
| CÓDIGO LEI Original Legal Entity Identifier | 95980020140005209853 |
|--|----------------------|

| | BLOOMBERG TICKER |
|---------|------------------|
| TRAMO A | GOYAH 2011-5 A |
| TRAMO B | GOYAH 2011-5 B |

CONTRAPARTIDAS

| CONTRAPARTIDA | ENTIDAD | DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD |
|-------------------------------------|---------------------|-----------------------------|
| Agente de Pagos | BARCLAYS BANK, S.A. | CAIXABANK, S.A. |
| Depositorio Cuenta Tesorería | BARCLAYS BANK, S.A. | CAIXABANK, S.A. |
| Contrapartida Swap | BARCLAYS BANK, S.A. | CAIXABANK, S.A. |
| Depositorio Garantía Swap | NO APLICA | NO APLICA |
| Administrador | BARCLAYS BANK, S.A. | CAIXABANK, S.A. |
| Depositorio Reserva Commingling | NO APLICA | NO APLICA |
| Back up Servicer | NO APLICA | NO APLICA |
| Acreditante Línea Liquidez | NO APLICA | NO APLICA |
| Depositorio Garantía Línea Liquidez | NO APLICA | NO APLICA |
| Avalista | NO APLICA | NO APLICA |

ACCIONES CORRECTIVAS

CONCLUIDAS

| ACCIÓN | FECHA | ENTIDAD DEPOSITARIA |
|---|------------|---------------------|
| 1ª Modificación de la Escritura de Constitución a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero, la Parte B del Contrato de Permuta Financiera de Intereses y el Administrador en caso de descenso de su calificación por Fitch y DBRS | 23/01/2015 | |
| Cambio denominación Cuenta de Tesorería como consecuencia de la absorción de Barclays Bank SA por parte de CaixaBank | 18/05/2015 | |
| 2ª Escritura de Modificación con objeto de adaptar la regulación de cada Fondo a los requisitos previstos en la modificación a la Orientación del Banco Central Europeo de 19 de diciembre de 2014 (BCE/2015/510) | 17/09/2015 | |

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 | BBB | F2 | 30 | Hábiles |
| DBRS | BBB (high) | N/A | 30 | Naturales |

| RATING CONTRAPARTIDA | | | | | |
|-----------------------|-------------------------|------------------------|-------------|------------------|-------------------|
| ENTIDAD CONTRAPARTIDA | AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | TRIGGER ACTIVADO | PLAZO SUBSANACIÓN |
| | | Largo plazo | Corto plazo | | |
| CAIXABANK, S.A. | FITCH | BBB+ | F2 | NO | N/P |
| | DBRS | A | R-1 (Low) | NO | N/P |

CONTRAPARTIDA SWAP

| CONDICIONES DOCUMENTACIÓN | | | | |
|---------------------------|------------------------|-------------|-------------------|---------------------|
| AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
| | Largo plazo | Corto plazo | | |
| FITCH | BBB | F2 | 14 | Naturales |
| CON COLATERAL | BB+ | N/A | 30 | Naturales |
| DBRS | BBB | N/A | 30 | Hábiles |
| CON COLATERAL | BBB | N/A | 30 | Hábiles |

| RATING CONTRAPARTIDA | | | | | |
|-----------------------|-------------------------|------------------------|-------------|------------------|-------------------|
| ENTIDAD CONTRAPARTIDA | AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | TRIGGER ACTIVADO | PLAZO SUBSANACIÓN |
| | | Largo plazo | Corto plazo | | |
| CAIXABANK, S.A. | FITCH | | | NO | N/P |
| | CON COLATERAL | BBB+ | F2 | NO | N/P |
| | DBRS | | | NO | N/P |
| | CON COLATERAL | A | R-1 (Low) | NO | N/P |

ADMINISTRADOR

| CONDICIONES DOCUMENTACIÓN | | | | |
|---------------------------|------------------------|-------------|-------------------|---------------------|
| AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
| | Largo plazo | Corto plazo | | |
| FITCH | BBB | F2 | 14 | Naturales |
| DBRS | BBB (Low) | N/A | 30 | Naturales |

| RATING CONTRAPARTIDA | | | | | |
|-----------------------|-------------------------|------------------------|-------------|------------------|-------------------|
| ENTIDAD CONTRAPARTIDA | AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | TRIGGER ACTIVADO | PLAZO SUBSANACIÓN |
| | | Largo plazo | Corto plazo | | |
| CAIXABANK, S.A. | FITCH | BBB+ | F2 | NO | N/P |
| | DBRS | A | R-1 (Low) | NO | N/P |

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

SIN ACTUACIONES PENDIENTES