



AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A. - SERIE SA NOSTRA I-

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	Se podrán realizar siempre que se mantenga la Entidad de Contrapartida inicial del Contrato de Swap,	N/A
FECHA FINALIZACION	16/05/2047	16/05/2047

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	SEMESTRAL	
	16	MAYO NOVIEMBRE
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)		

Anterior Fecha de Pago de Cupón	16/05/2018	
Anterior Fecha de Determinación	08/05/2018	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	16/11/2018	

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 6M	0,17 %	11/05/2018	-0,271 %	0,000%
TRAMO B	EUR 6M	0,30 %	11/05/2018	-0,271 %	0,029%
TRAMO C	EUR 6M	0,65 %	11/05/2018	-0,271 %	0,379%
TRAMO D	EUR 6M	2,00 %	11/05/2018	-0,271 %	1,729%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 6M	2,00 %	11/05/2018	-0,271 %	1,729%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN	AMORTIZADO	AMORTIZADO	AMORTIZADO	AMORTIZADO	AMORTIZADO

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

INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI Original Legal Entity Identifier	95980020140005216158
------------------------------------------------	----------------------

	BLOOMBERG TICKER
TRAMO A	AYTCG 07-SAN1 A
TRAMO B	AYTCG 07-SAN1 B
TRAMO C	AYTCG 07-SAN1 C
TRAMO D	AYTCG 07-SAN1 D

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	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
	FITCH	A-	F2	NO	N/P

CONTRAPARTIDA 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
CON COLATERAL	BBB-	N/A	N/A	N/A
FITCH	A-	F2	N/A	N/A
CON COLATERAL	BBB-	F3	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
CECABANK, S.A.	STANDARD & POORS	BBB	A-2	NO	N/P
	CON COLATERAL			NO	N/P
	FITCH	BBB-	F3	NO *	N/P
	CON COLATERAL			NO	N/P

* NOTAS

S&P: Conforme recogido en documentación, el trigger se detonará en caso de que el mantenimiento de CECABANK suponga que los Bonos no puedan mantener la calificación A-. Confirmación de S&P de que la operación sin swap puede mantener dicha calificación.

FITCH: Se ha establecido un depósito en Banco Santander, en garantía de las obligaciones de CECABANK como Entidad de Contrapartida de Swap

DEPOSITARIO GARANTÍA SWAP

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	A-	F2	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.	STANDARD & POORS	A	A-1	NO	N/P
	FITCH	A-	F2	NO	N/P

* NOTAS

Existe una cuenta abierta para regular el potencial establecimiento de un depósito en garantía del Administrador.

Actualmente no es necesario proceder con un depósito, y por lo tanto, la cuenta, aunque abierta, no está siendo utilizada. No hay trigger explícito para el Administrador

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

SIN ACTUACIONES PENDIENTES