



## GC FTPYME PASTOR 4, 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 | El Administrador ya no podrá realizar futuras renegociaciones de tipos de interés de los Préstamos Hipotecarios que administra si el último día del mes precedente, el tipo de interés medio ponderado de las Participaciones Hipotecarias resultara inferior al Euribor tres (3) meses más un 0,60% anual. | 2,849%>0,279% |
| FECHA FINALIZACION            | 30/09/2035  | 30/09/2035    |

#### CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

##### FECHAS DE PAGO

| Frecuencia de pago de cupón                     | TRIMESTRAL |                                    |
|---|------------|------------------------------------|
| Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil) | 15         | ENERO<br>ABRIL<br>JULIO<br>OCTUBRE |

|                                 |            |  |
|---------------------------------|------------|--|
| Anterior Fecha de Pago de Cupón | 16/07/2018 |  |
| Anterior Fecha de Determinación | 10/07/2018 | 4 días hábiles antes de la Fecha de Pago |
| Próxima Fecha de Pago           | 15/10/2018 |  |

##### 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 C                                  | EUR 3M                 | 0,29 % | 12/07/2018     | -0,321 %                | 0,000%                    |
| TRAMO D                                  | EUR 3M                 | 0,53 % | 12/07/2018     | -0,321 %                | 0,209%                    |
| TRAMO E                                  | EUR 3M                 | 2,40 % | 12/07/2018     | -0,321 %                | 2,079%                    |
| PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA    | EUR 3M                 | 1,50 % | 12/07/2018     | -0,321 %                | 1,179%                    |
| PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN | EUR 3M                 | 0,30 % | 12/07/2018     | -0,321 %                | 0,000%                    |

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

##### INFORMACIÓN ADICIONAL

|  |                      |
|--|----------------------|
| CÓDIGO LEI<br>Original Legal Entity Identifier | 54930081SHHWJEY6G124 |
|  | BLOOMBERG TICKER     |
| TRAMO C  | PAST 4 B             |
| TRAMO D  | PAST 4 C             |
| TRAMO E  | PAST 4 D             |

## CONTRAPARTIDAS

| CONTRAPARTIDA                       | ENTIDAD                               | DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD           |
|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| Agente de Pagos                     | BNP PARIBAS, S.A., SUCURSAL EN ESPAÑA | BNP PARIBAS, S.A., SUCURSAL EN ESPAÑA |
| Depositario Cuenta Tesorería        | BNP PARIBAS, S.A., SUCURSAL EN ESPAÑA | BNP PARIBAS, S.A., SUCURSAL EN ESPAÑA |
| Contrapartida Swap                  | CAIXABANK, S.A.                       | CAIXABANK, S.A.                       |
| Depositario Garantía Swap           | NO APLICA                             | NO APLICA                             |
| Administrador                       | BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.           | BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.           |
| Depositario Reserva Commingling     | NO APLICA                             | NO APLICA                             |
| Back up Servicer                    | EOS SPAIN, S.L.                       | EOS SPAIN, S.L.                       |
| Acreditante Línea Liquidez          | NO APLICA                             | NO APLICA                             |
| Depositario Garantía Línea Liquidez | NO APLICA                             | NO APLICA                             |
| Avalista                            | REINO DE ESPAÑA                       | REINO DE ESPAÑA                       |

## ACCIONES CORRECTIVAS

### CONCLUIDAS

| ACCIÓN | FECHA | ENTIDAD DEPOSITARIA |
|--------|-------|---------------------|
| N/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          | N/A                    | A-1         | 30                | Naturales           |
| MOODY'S                   | N/A                    | P-1         | 30                | Naturales           |

| RATING CONTRAPARTIDA                  |                         |                        |             |                  |                   |
|---------------------------------------|-------------------------|------------------------|-------------|------------------|-------------------|
| ENTIDAD CONTRAPARTIDA                 | AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE |             | TRIGGER ACTIVADO | PLAZO SUBSANACIÓN |
|                                       |                         | Largo plazo            | Corto plazo |                  |                   |
| BNP PARIBAS, S.A., SUCURSAL EN ESPAÑA | STANDARD & POORS        | A                      | A-1         | NO               | N/P               |
|                                       | MOODY'S                 | Aa3                    | P-1         | NO               | N/P               |

## CONTRAPARTIDA SWAP

| CONDICIONES DOCUMENTACIÓN |                        |             |                   |                     |
|---------------------------|------------------------|-------------|-------------------|---------------------|
| AGENCIA DE CALIFICACIÓN   | RATING MINIMO EXIGIBLE |             | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
|                           | Largo plazo            | Corto plazo |                   |                     |
| STANDARD & POORS          | N/A                    | A-1         | 60                | Naturales           |
| CON COLATERAL             | N/A                    | A-3         | 60                | Naturales           |
| MOODY'S                   | A2                     | P-1         | 30                | Hábiles             |
| CON COLATERAL             | A3                     | P-2         | 30                | Hábiles             |

| RATING CONTRAPARTIDA  |                         |                        |             |                  |                   |
|-----------------------|-------------------------|------------------------|-------------|------------------|-------------------|
| ENTIDAD CONTRAPARTIDA | AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE |             | TRIGGER ACTIVADO | PLAZO SUBSANACIÓN |
|                       |                         | Largo plazo            | Corto plazo |                  |                   |
| CAIXABANK, S.A.       | STANDARD & POORS        |                        |             | SI*              | N/P               |
|                       | CON COLATERAL           | A-                     | A-2         | NO               | N/P               |
|                       | MOODY'S                 |                        |             | SI*              | N/P               |
|                       | CON COLATERAL           | A3                     | P-2         | SI*              | N/P               |

### \* NOTAS

**S&P** : La participación de Caixabank, S.A. como Entidad de Contrapartida de Swap no tiene impacto negativo sobre las calificaciones otorgadas a los bonos. La calificación de la contrapartida del derivado es superior a la calificación del tramo más senior de bonos.

**MOODY'S**: La participación de Caixabank, S.A. como Entidad de Contrapartida de Swap no tiene impacto negativo sobre las calificaciones otorgadas a los bonos.

## PROCESOS A EFECTUAR

### ACTUACIONES EN CAMINO

SIN ACTUACIONES PENDIENTES