

AYT GÉNOVA HIPOTECARIO IX, 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	LIMITE ACTUAL
NOVACIONES DE TIPO DE INTERES	El Administrador no podrá, en ningún caso (ni siquiera a instancias de la Sociedad Gestora), entablar renegociaciones de tipo de interés que puedan resultar en una disminución del tipo de interés aplicable a un Préstamo Hipotecario Participado.	N/A
FECHA FINALIZACION	29/06/2036	29/06/2036

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	TRIMESTRAL	
	15	ENERO ABRIL JULIO OCTUBRE
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)		

Anterior Fecha de Pago de Cupón	15/07/2022	
Anterior Fecha de Determinación	08/07/2022	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	17/10/2022	

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 A2	EUR 3M	0,15 %	13/07/2022	-0,052 %	0,098%
TRAMO B	EUR 3M	0,22 %	13/07/2022	-0,052 %	0,168%
TRAMO C	EUR 3M	0,47 %	13/07/2022	-0,052 %	0,418%
TRAMO D	EUR 3M	2,25 %	13/07/2022	-0,052 %	2,198%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 3M	2,25 %	13/07/2022	-0,052 %	2,198%
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	95980020140005212957
Original Legal Entity Identifier	

	BLOOMBERG TICKER
TRAMO A2	AYTGH 1X A2
TRAMO B	AYTGH 1X B
TRAMO C	AYTGH 1X C
TRAMO D	AYTGH 1X D

CONTRAPARTIDAS

CONTRAPARTIDA	ENTIDAD	DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD
Agente de Pagos	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA
Depositario Cuenta Tesorería	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA
Contrapartida Swap	BANCO SANTANDER, S.A	BANCO SANTANDER, S.A
Depositario Garantía Swap	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA
Administrador	BARCLAYS BANK, S.A.	CAIXABANK, S.A.
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
Adecuación CS y AF a Criterio S&P 2010	05/07/2011	
Incorporación de SociétÉ Générale en sustitución de Barclays Bank SA como Agente Financiero	21/01/2015	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA
Establecimiento en SG Sucursal en España, depósito en garantía de las obligaciones de Barclays Bank PLC como CS de la operación.	09/07/2015	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA
Modificación Número de Cuenta de Tesorería y de la remuneración aplicable a la misma	20/05/2016	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA
Modificación Número de Cuenta de Garantías y de la remuneración aplicable a la misma	20/05/2016	SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA
1ª Escritura de Modificación, a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por la Parte B del Contrato de Permuta Financiera de Intereses en caso de descenso de su calificación por S&P, Fitch y MOODY'S, así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen	30/01/2017	
Incorporación de Banco Santander en sustitución de Barclays Bank PLC, como Parte B del Contrato de Permuta Financiera de Intereses	30/01/2017	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		
STANDARD & POORS	A	A-1	60	Naturales
FITCH	N/A	F1	60	Naturales
MOODY'S	N/A	P-1	60	Naturales

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA	STANDARD & POORS	A	A-1	NO	N/P
	FITCH	A-	F1	NO	N/P
	MOODY'S	A1	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	A	N/A	10	Hábiles
CON COLATERAL	BBB+	N/A	60	Naturales
FITCH	BBB	F2	30	Naturales
CON COLATERAL	BB+	N/A	30	Naturales
MOODY'S	A3	N/A	30	Hábiles
CON COLATERAL	Baa1	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	STANDARD & POORS			NO *	N/P
	CON COLATERAL	AA-	A-1+	NO	N/P
	FITCH			NO	N/P
	CON COLATERAL	A	F1	NO	N/P
	MOODY'S			NO	N/P
	CON COLATERAL	A2	P-1	NO	N/P

* NOTAS

S&P: Se ha establecido un depósito en garantía de las obligaciones de la 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	A	N/A	N/A	N/A
FITCH	BBB+	F2	N/A	N/A
MOODY'S	Baa3	N/A	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA	STANDARD & POORS	A	A-1	NO	N/P
	FITCH	A	F1	NO	N/P
	MOODY'S	A1	P-1	NO	N/P

ADMINISTRADOR

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
STANDARD & POORS	N/A	A-1	N/A	N/A
FITCH	N/A	N/A	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		
CAIXABANK, S.A.	STANDARD & POORS	A-	A-2	NO*	N/P
	FITCH	BBB+	F2	NO	N/P
	MOODY'S	A3	P-2	NO	N/P

*** NOTAS**

S&P : La participación de Caixabank, S.A. como Administrador no tiene impacto negativo sobre las calificaciones otorgadas a los bonos, de forma que no es preciso llevar a cabo acciones correctivas

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

SIN ACTUACIONES PENDIENTES