AYT GÉNOVA HIPOTECARIO XI, 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	25/09/2037	25/09/2037

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	TRIMESTRAL	
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)	15	FEBRERO MAYO AGOSTO NOVIEMBRE

Anterior Fecha de Pago de Cupón	17/08/2026	
Anterior Fecha de Determinación	10/08/2026	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	16/11/2026	

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	0,20 %	13/08/2026	2,511 %	2,711%
TRAMO B	EUR 3M	0,30 %	13/08/2026	2,511 %	2,811%
TRAMO C	EUR 3M	0,60 %	13/08/2026	2,511 %	3,111%
TRAMO D	EUR 3M	2,50 %	13/08/2026	2,511 %	5,011%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 3M	2,50 %	13/08/2026	2,511 %	5,011%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN	EUR 3M	2,50 %	13/08/2026	2,511 %	5,011%

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

INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI Original Legal Entity Identifier	95980020140005209950

	BLOOMBERG TICKER
TRAMO A2	AYT GHXI A2
TRAMO B	AYT GHXI B
TRAMO C	AYT GHXI C
TRAMO D	AYT GHXI D

CONTRAPARTIDAS

CONTRAPARTIDA	ENTIDAD	DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD
Agente de Pagos	**CAIXABANK, S.A.**	**CAIXABANK, S.A.**
Depositario Cuenta Tesorería	**CAIXABANK, S.A.**	**CAIXABANK, S.A.**
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 Criteria S&P 2010	05/07/2011	
2ª Modificación de la Escritura de Constitución a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero y el Administrador en caso de descenso de su calificación por FITCH y STANDARD & POOR´S	23/01/2015	
Cambio denominación Cuenta de Tesorería como consecuencia de la absorción de Barclays Bank SA por parte de Caixabank	18/05/2015	
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 Garantías y de la remuneración aplicable a la misma	20/05/2016	
3ª 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 FITCH y S&P, así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro.	21/12/2016	
Incorporación de Banco Santander en sustitución de Barclays Bank PLC, como Parte B del Contrato de Permuta Financiera de Intereses	21/12/2016	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	BBB-	N/A	60	Naturales
FITCH	BBB+	F2	60	Naturales

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-1	NO	N/P
	FITCH	A+	F1	NO	N/P

**** NOTAS***

FITCH : *El rating de el Agente de Pagos es suficiente para que los bonos alcancen una calificación "A-".*

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	14	Naturales
CON COLATERAL	BB+	N/A	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	AA-	A-1+	NO	N/P
	CON COLATERAL			NO	N/P
	FITCH	A+	F1	NO	N/P
	CON COLATERAL			NO	N/P

DEPOSITARIO GARANTÍA 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
FITCH	BBB+	F2	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

ADMINISTRADOR

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	BBB	F2	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-1	NO	N/P
	FITCH	A+	F1	NO	N/P

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

SIN ACTUACIONES PENDIENTES