



AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, F.T.A

- SERIE CAJA GRANADA 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	23/09/2037	23/09/2037

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	SEMESTRAL	
	24	MARZO SEPTIEMBRE
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)		
Anterior Fecha de Pago de Cupón	26/03/2018	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Anterior Fecha de Determinación	19/03/2018	
Próxima Fecha de Pago	24/09/2018	

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	0,30 %	22/03/2018	-0,271 %	0,029%
TRAMO B	EUR 6M	0,60 %	22/03/2018	-0,271 %	0,329%
TRAMO C	EUR 6M	1,25 %	22/03/2018	-0,271 %	0,979%
TRAMO D	EUR 6M	2,50 %	22/03/2018	-0,271 %	2,229%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 6M	2,00 %	22/03/2018	-0,271 %	1,729%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN	EUR 6M	2,00 %	22/03/2018	-0,271 %	1,729%

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

INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI Original Legal Entity Identifier	95980020140005217225
--	----------------------

	BLOOMBERG TICKER
TRAMO A	AYTGE 2009-CG1 A
TRAMO B	AYTGE 2009-CG1 B
TRAMO C	AYTGE 2009-CG1 C
TRAMO D	AYTGE 2009-CG1 D

CONTRAPARTIDAS

CONTRAPARTIDA	ENTIDAD	DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD
<i>Agente de Pagos</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Depositario Cuenta Tesorería</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Contrapartida Swap</i>	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO	CECABANK, S.A.
<i>Depositario Garantía Swap</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Administrador</i>	BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	BANKIA, S.A
<i>Depositario Reserva Commingling</i>	NO APLICA	NO APLICA
<i>Back up Servicer</i>	NO APLICA	NO APLICA
<i>Acreditante Línea Liquidez</i>	NO APLICA	NO APLICA
<i>Depositario Garantía Línea Liquidez</i>	NO APLICA	NO APLICA
<i>Avalista</i>	NO APLICA	NO APLICA

ACCIONES CORRECTIVAS

CONCLUIDAS

ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
Modificación de Escritura a los efectos de incorporar a Moodys como Agencia de Calificación	13/12/2010	
Establecimiento en CECA de un depósito en garantía de CECA como CS	02/04/2012	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Traslado AF desde CECA a Barclays Bank PLC. Sucursal en España	17/07/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
2ª Modificación de Escritura a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero y la Entidad de Contrapartida del Contrato de Swap en caso de descenso de su calificación por MOODY'S INVESTORS SERVICE ESPAÑA, S.A. ("MOODY'S") y FITCH RATINGS ESPAÑA, S.A.U. ("FITCH"), así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro	08/08/2012	
Traslado Cuenta Depósito en garantía de las obligaciones de CECA como CS desde CECA a Barclays Bank PLC SE	08/08/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
Traslado Cuenta Tesorería a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
Traslado Cuenta Depósito Swap a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
3ª Escritura de Modificación de la Escritura de Constitución a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación por FITCH RATINGS ESPAÑA, S.A.U. ("FITCH") y MOODY'S INVESTORS SERVICE ESPAÑA, S.A. ("MOODY'S"), así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro, y otras modificaciones derivadas de la suscripción de un nuevo Contrato de Prestación de Servicios Financieros	21/03/2016	
Traslado Agente Financiero desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	21/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado depositaría cuenta de depósito en garantía de la CS desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	21/03/2016	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		
FITCH	A-	F2	30	Naturales
MOODY'S	A3	N/A	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.	FITCH	A-	F2	NO	N/P
	MOODY'S	A3	P-2	NO	N/P

CONTRAPARTIDA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	A-	F2	30	Naturales
CON COLATERAL	BBB-	F3	30	Naturales
MOODY'S	N/A	N/A	N/A	N/A
CON COLATERAL	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		
CECABANK, S.A.	FITCH			NO *	N/P
	CON COLATERAL	BBB-	F3	NO	N/P
	MOODY'S			NO	N/P
	CON COLATERAL	Baa2	P-2	NO	N/P

* NOTAS

FITCH : Se ha establecido un depósito en garantía de las obligaciones de la CS, siguiendo las especificaciones recogidas en documentación.

MOODY'S: No existe trigger explícito, si bien, el depósito establecido se está recalculando teniendo en cuenta los criterios de esta Agenci de Calificación.

DEPOSITARIO GARANTÍA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	A-	F2	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		
BANCO SANTANDER, S.A.	FITCH	A-	F2	NO	N/P
	MOODY'S	A3	P-2	NO	N/P

ADMINISTRADOR

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MINIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	A-	F2	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		
BANKIA, S.A	FITCH	BBB-	F3	SI*	N/P
	MOODY'S	Baa3	P-3	NO	N/P

* NOTAS
<i>FITCH: El mantenimiento de la Entidad Administradora no tiene impacto sobre la calificación otorgada a los Bonos</i>

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

SIN ACTUACIONES PENDIENTES