



# 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	15/04/2021	
Anterior Fecha de Determinación	08/04/2021	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	15/07/2021	

#### 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 A2	EUR 3M	0,15 %	13/04/2021	-0,538 %	0,000%
TRAMO B	EUR 3M	0,22 %	13/04/2021	-0,538 %	0,000%
TRAMO C	EUR 3M	0,47 %	13/04/2021	-0,538 %	0,000%
TRAMO D	EUR 3M	2,25 %	13/04/2021	-0,538 %	1,712%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 3M	2,25 %	13/04/2021	-0,538 %	1,712%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN	EUR 3M	2,25 %	13/04/2021	-0,538 %	1,712%

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

#### INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI Original Legal Entity Identifier	95980020140005212957
--	----------------------

	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 MÍNIMO 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 <i>CON COLATERAL</i>	A	N/A	10	Hábiles
	BBB+	N/A	60	Naturales
FITCH <i>CON COLATERAL</i>	BBB	F2	30	Naturales
	BB+	N/A	30	Naturales
MOODY'S <i>CON COLATERAL</i>	A3	N/A	30	Hábiles
	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			<b>NO *</b>	N/P
	<i>CON COLATERAL</i>	A+	A-1	NO	N/P
	FITCH			NO	N/P
	<i>CON COLATERAL</i>	A	F1	NO	N/P
	MOODY'S			NO	N/P
	<i>CON COLATERAL</i>	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	BBB+	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