#### ESTADO S.05.3

### **AyT Hipotecario Mixto II, FTA Serie CH**

## CUADRO A: INFORMACIÓN SOBRE LAS MEJORAS CREDITICIAS DEL FONDO

#### CONTRAPARTIDAS Y RATINGS

		SITUACIÓN ACTUAL						SITUACIÓN CIERRE ANUAL ANTERIOR						SITUACIÓN INICIAL													
	1.3	1.4 RATING DE LA CONTRAPARTIDA				1.5	1.5 RATING REQUERIDO DE LA CONTRAPARTIDA			1.3	1.4 RATING DE LA CONTRAPARTIDA			1.5 RATING REQUERIDO DE LA CONTRAPARTIDA				1.4 RATING DE LA CONTRAPARTIDA				1.5 RATING REQUERIDO DE LA CONTRAPARTIDA					
	DENOMINACIÓN	Moody's	Fitch	S&P	DBRS	Moody's	Fitch	S&P	DBRS	DENOMINACIÓN	Moody's	Fitch	S&P	DBRS	Moody's	Fitch	S&P	DBRS	1.3 DENOMINACIÓN	Moody's	Fitch	S&P	DBRS	Moody's	Fitch	S&P	DBRS
		LP CP	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP		LP CP	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP		LP CP	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP
	BANKIA, S.A.	Baa2 P-2	BBB- F3	BBB A-2	BBB R-1 (high) (low)	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	BANKIA, S.A.	Baa2 P-2	BBB- F3	BBB A-2	BBB R-1 (high) (low)	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	A3 P-1	NR NR	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	A N/A N/A
CONTRAPARTIDA FONDO DE RESERVA	BANKIA, S.A.	Baa2 P-2	BBB- F3	BBB A-2	BBB R-1 (high) (low)	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	Baa2 P-2	BBB- F3	BBB A-2	BBB R-1 (high) (low)	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	NR NR	A- F2	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	\ N/A N/A
	CAIXABANK, S.A.	Baa1 P-2	BBB+ F2	BBB+ A-2	A R-1 (Low)	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	CAIXABANK, S.A.	Baa1 P-2	BBB+ F2	BBB+ A-2	A R-1 (Low)	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE HUELVA Y SEVILLA	NR NR	A- F2	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	A N/A N/A
CONTRAPARTE DE LA LÍNEA DE LIQUIDEZ	N/P									N/P									N/P								
ENTIDAD AVALISTA	N/P									N/P									N/P								



### **HECHOS RELEVANTES**

FONDO	FECHA DE CONSTITUCIÓN	RATING	DESCRIPCIÓN	HECHO RELEVANTE - CNMV
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		Modificación al alza de la serie PH1 de Aa2 y de Aa1 y de la serie CH2 de Aa2 a Aa1, por parte de Moodys	4189509 27 de abril de 2018
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	СН	Fijación tipo de los bonos	4123373 20 de septiembre de 2017
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		Amortización Parcial de Activos según lo previsto en el punto IV.1 d del folleto de constitución.	4122298 14 de septiembre de 2017
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	СН	Actuación sobre los contratos de cobertura derivado de la no aplicación de los tipos de interés mínimos.	4102698 20 de junio de 2017
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	СН	Fijación tipo de los bonos	4102258 19 de junio de 2017
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	СН	Fijación tipo de los bonos	4070158 16 de marzo de 2017
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	сн	Modificación al alza de la serie CH2 de A1 (sf) a Aa2 (sf), por parte de Moodys	4064540 27 de febrero de 2017
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	СН	Fijación tipo de los bonos	4045108 16 de diciembre de 2016
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	СН	Fijación tipo de los bonos	4024185 16 de septiembre de 2016
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		Modificación a la baja del tramo CH2 de A a A-, por parte de Fitch Ratings	4009449 18 de julio de 2016
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		Modificación Escritura y sustitución Agente Financiero	4003435 21 de junio de 2016
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	СН	Fijación tipo de los bonos	4002406 16 de junio de 2016
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		Fijación tipo de los bonos	3727176 17 de marzo de 2016
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		Modificación al alza de la calificación de la Serie PH1 de A1(sf) a Aa2(sf), de la Serie CH1 de A1(sf) a Aa2(sf) y de la Serie CH2 de Baa1(sf) a A3(sf) por parte de Moody's Investors Service	3432732 26 de enero de 2015
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		Modificación al alza de la calificación de las Series PH1, CH1, CH2 por parte de Fitch Ratings	3196548 26 de agosto de 2014
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	СН	Modificación al alza de la calificación de los bonos del Tramo CH1 por parte de Moody 's como consecuencia de la modificación de calificación de la deuda a largo plazo de España	№ 2926792 20 de marzo de 2014
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		Rebaja de la calificación de los Tramos CH2, de Baa1(sf) a Baa3(sf), y PH2, de Baa3(sf) a Ba3(sf) por parte de Moody's.	Nº 2432844 14 de mayo de 2013
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		Acciones remediales efectuadas para la sustitución de CECA como Agente Financiero, siendo el nuevo Agente Financiero Barclays Bank PLC	Nº 1925964 18 de julio de 2012

FONDO	FECHA DE CONSTITUCIÓN	RATING	DESCRIPCIÓN	HECHO RELEVANTE - CNMV		
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		Rebaja de la calificación del <b>Tramo CH1</b> de Aa2(sf) a A3(sf) y <b>Tramo PH1</b> de Aa2(sf) a A3(sf) por parte de	Nº 1905909		
, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,			Moody's, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	6 de julio de 2012		
		Tramo PH1 - Aa2(sf)/AA-sf Tramo PH2 - Baa3(sf)/BBBsf	Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos PH1	№ 1905909		
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	29/06/2004	Tramo CH1 - Aa2(sf)/AA-sf	[AAAsf] y <b>CH1</b> [AAAsf], como consecuencia de la rebaja de		
		Tramo CH2 - Baa1(sf)/BBB+sf	calificación de la deuda a largo plazo de España.	14 de junio de 2012		
	20/05/2004		Acciones remediales efectuadas con motivo de la bajada	Nº 1758965		
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		de rating de CECA.	13 de abril de 2012		
		Tramo PH1 - Aa2(sf)/AAAsf	Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos PH1	Nº 1689639		
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	Tramo PH2 - Baa3(sf)/BBBsf	[Aaa(sf)] Y <b>CH1</b> [Aaa(sf)], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable a Aa2(sf) por parte de			
		Tramo CH1 - Aa2(sf)/AAAsf	Moody's a la titulización española.	28 de febrero de 2012		
		Tramo CH2 - Baa1(sf)/BBB+sf				
		Tramo PH1 - Aaa(sf)/AAAsf		Nº 907555		
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	Tramo PH2 – Baa3(sf)/BBBsf	Modificación al alza de los bonos del Tramo PH2 por parte de Fitch Ratings.			
		Tramo CH1 - Aaa(sf)/AAAsf	parte de l'iten Ratings.	8 de junio de 2011		
		Tramo CH2 - Baa1(sf)/BBB+sf	Transferencia de ciertos derechos y obligaciones			
		Serie PH1 – Aaa/AAA Serie PH2 – Baa3/BBB	recogidas en los Contratos de Swap de BEAR STEARNS	Nº 249637		
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	Serie PH2 – Baa3/BBB Serie CH1 – Aaa/AAA	BANK PLC a JP MORGAN CHASE BANK, N.A. como	28 de julio de 2009		
		Serie CH2 – Baa1/BBB	consecuencia de los procesos de reestructuración y fusión de dichas entidades.			
		Tramo PH1 - Aaa/AAA	Restablecimiento de la calificación de la Entidad de			
		Tramo PH2 - Baa3/BBB	contrapartida (Bear Stearns Bank PLC).	Nº 80378		
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	Tramo CH1 - Aaa/AAA	,			
		Tramo CH2 - Baa3/BBB	Devolución del depósito.	1 de agosto de 2008		
		Tramo PH1 - Aaa/AAA	Rebaja de la calificación de la Entidad de contrapartida			
		Tramo PH2 - Baa3/BBB	(Bear Stearns Bank PLC).	№ 55952		
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	Tramo CH1 - Aaa/AAA				
		Tramo CH2 - Baa3/BBB	Garantía de JP MORGAN CHASE & CO.	29 de mayo de 2008		
		Tramo PH1 - Aaa/AAA	Rebaja de la calificación de la Entidad de contrapartida	Nº 89219		
A.T. Hardanada Minta II III	20/06/2004	Tramo PH2 - Baa3/BBB	(Bear Stearns Bank PLC).			
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	Tramo CH1 - Aaa/AAA	Formalización de depósito formalizado y apertura de una	44 4-6-6 4-0000		
		Tramo CH2 - Baa3/BBB	Cuenta de Depósito.	11 de febrero de 2008		



# MODIFICACIONES ESCRITURA

	Fecha Modificación	Estipulaciones modificadas
AyT Hipotecario Mixto II, FTA	17/06/2016	ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE. ESTIPULACIÓN 18.1. MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN DE SERVICIOS FINANCIEROS