

### CONTRAPARTIDAS ESTADO S.05.3

|  |                    |           |
|--|--------------------|-----------|
|  | CAIXABANK          | A08663619 |
| CONTRAPARTIDA FONDO DE RESERVA                   | BANCO MARE NOSTRUM | A86104189 |
|  | ABANCA             | A70302039 |
|  | CAIXA ONTINYENT    | G46002796 |
| CONTRAPARTIDA PERMUTA FINANCIERA TIPO DE INTERÉS | CECABANK           | A86436011 |
| CONTRAPARTIDA PERMUTA FINANCIERA TIPO DE CAMBIO  | N/P                |           |
| OTRAS PERMUTAS FINANCIERAS                       | N/P                |           |
| CONTRAPARTE DE LA LÍNEA DE LIQUIDEZ              | CECABANK           | A86436011 |
| ENTIDAD AVALISTA                                 | ICO                | Q2876002C |
| CONTRAPARTE DEL DERIVADO DE CRÉDITO              | N/P                |           |



## HECHOS RELEVANTES

| FONDO               | FECHA DE CONSTITUCIÓN | RATING   | DESCRIPCIÓN  | HECHO RELEVANTE - CNMV                |
|---------------------|-----------------------|--|--|---------------------------------------|
| AyT ICO-FTVPO I FTA | 16/03/2009            |  | Modificación de las actuaciones a realizar por las contrapartidas en caso de descenso de su calificación y sustitución de Agente Financiero.   | 3728638<br>23 de marzo de 2016        |
| AyT ICO-FTVPO I FTA | 16/03/2009            |  | Modificación al alza del tramo B de A3 (sf) a A1 (sf) y del tramo C de Ba2 (sf) a Ba1 ( sf), por parte de Moodys   | 3660707<br>13 de julio de 2015        |
| AyT ICO-FTVPO I FTA | 16/03/2009            |  | Modificación al alza de la calificación del Tramo A(G) de A1(sf) a Aa2(sf), del Tramo B de Baa2(sf) a A3(sf) y del Tramo C de B1(sf) a Ba2(sf), por parte de Moody's Investors Service                                     | Nº 3434850<br>27 de enero de 2015     |
| AyT ICO-FTVPO I FTA | 16/03/2009            |  | Modificación al alza de la calificación del Tramo A de A3 a A1, del Tramo B de Ba1 a Baa2 y del Tramo C de B2 a B1 por parte de Moody's  | Nº 3260624<br>8 de octubre de 2014    |
| AyT ICO-FTVPO I FTA | 16/03/2009            |  | * Rebaja de la calificación de los Tramos <b>B</b> , de Baa1(sf) a Ba1(sf), y <b>C</b> , de Baa3(sf) a B2(sf) por parte de Moody's.  | Nº 2430326<br>13 de mayo de 2013      |
| AyT ICO-FTVPO I FTA | 16/03/2009            | Tramo A(G) – A3(sf)/AA-sf<br>Tramo B – Baa1(sf)/Asf<br>Tramo C – Baa3(sf)/BBB-sf | * Rebaja de la calificación por parte de Moody's del <b>Tramo B</b> de A3(sf) a Baa1(sf).  | Nº 2145269<br>28 de noviembre de 2012 |
| AyT ICO-FTVPO I FTA | 16/03/2009            |  | * Acciones remediales efectuadas para la sustitución de CECA como Agente Financiero, siendo el nuevo Agente Financiero Barclays Bank PLC   | Nº 1925997<br>18 de julio de 2012     |
| AyT ICO-FTVPO I FTA | 16/03/2009            |  | * Acciones remediales efectuadas para la sustitución de la CECA como Entidad de Contrapartida de SWAP, siendo la posible entidad sustituta BNP Paribas.  | Nº 1909861<br>9 de julio de 2012      |
| AyT ICO-FTVPO I FTA | 16/03/2009            | Tramo A(G) – A3(sf)/AA-sf<br>Tramo B – A3(sf)/Asf<br>Tramo C – Baa3(sf)/BBB-sf   | * Rebaja de la calificación del <b>Tramo A(G)</b> de Aa2(sf) a A3(sf) y <b>Tramo B</b> de Aa2(sf) a A3(sf) por parte de Moody's, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.       | Nº 1905994<br>6 de julio de 2012      |
| AyT ICO-FTVPO I FTA | 16/03/2009            | Tramo A(G) – Aa2(sf)/AA-sf<br>Tramo B – Aa2(sf)/Asf<br>Tramo C – Baa3(sf)/BBB-sf | * Rebaja de la calificación de los bonos del <b>Tramo A(G)</b> [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la rebaja de calificación de la deuda a largo plazo de España.                                     | Nº 1870951<br>14 de junio de 2012     |
| AyT ICO-FTVPO I FTA | 16/03/2009            | Tramo A(G) – Aa2(sf)/AAAsf<br>Tramo B – Aa2(sf)/Asf<br>Tramo C – Baa3(sf)/BBB-sf | * Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos <b>A(G)</b> [Aa(sf)] y <b>B</b> [Aa1(sf)], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable a Aa2(sf) por parte de Moody's a la titulación española. | Nº 1689663<br>28 de febrero de 2012   |

## MODIFICACIONES ESCRITURA

|                      | Fecha Modificación | Estipulaciones modificadas   |
|----------------------|--------------------|--|
| AYT ICO-FTVPO I, FTA | 16/03/2016         | ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE.<br>ESTIPULACIONES 18.1, 18.5, 18.7.2, Y 10.<br>MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN DE<br>SERVICIOS FINANCIEROS, CONTRATO DE LÍNEA DE<br>LIQUIDEZ, CONTRATO DE SWAP Y CONTRATO DE<br>ADMINISTRACIÓN. |