

CONTRAPARTIDAS

| CONTRAPARTIDA | ENTIDAD | DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD |
|-------------------------------------|---|---|
| Agente de Pagos | BANCO SANTANDER, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. |
| Depositario Cuenta Tesorería | BANCO SANTANDER, S.A. | BANCO SANTANDER, S.A. |
| Contrapartida Swap | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. |
| Depositario Garantía Swap | SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA | SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA |
| Administrador | MULTICEDENTE | MULTICEDENTE |
| Administrador | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA | CAIXABANK, S.A. |
| Administrador | CAIXA D'ESTALVIS COMARCAL DE MANLLEU | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. |
| Administrador | CAIXA DE CREDIT DELS ENGINYERS - CAJA DE CRÉDITO DE LOS INGENIEROS, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CRÉDITO | CAIXA DE CREDIT DELS ENGINYERS - CAJA DE CRÉDITO DE LOS INGENIEROS, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CRÉDITO |
| 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 |
|---|------------|---------------------------------------|
| Subrogación de BBVA en la posición de Caja Madrid como Entidad de Contrapartida de Swap | 10/05/2011 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. |
| Traslado Agente Financiero desde CECA a Barclays Bank PLC SE | 17/07/2012 | BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA |
| Establecimiento de un depósito en Banco Santander en garantía de las obligaciones de BBVA como Entidad de Contrapartida de Swap | 28/11/2012 | BANCO SANTANDER, S.A. |
| Traslado depositaria garantía-swap desde Banco Santander hasta SociÉTé Générale | 19/12/2014 | SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA |
| Traslado Cuenta Tesorería a Barclays Bank (UK) | 08/05/2015 | BARCLAYS BANK PLC |
| 1ª 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 Moodys, así como permitir que se apliquen criterios más actualizados que se publiquen en el futuro. | 17/06/2016 | |
| Incorporación de Banco Santander como Agente Financiero en sustitución de Barclays Bank PLC, Sucursal en España | 17/06/2016 | BANCO SANTANDER, S.A. |
| Modificación de la numeración y de la remuneración aplicable a la cuenta de depósito-swap por parte de SG | 08/07/2016 | SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA |

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 | | |
| MOODY'S | A3 | 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. | MOODY'S | A2 | P-1 | NO | N/A |

CONTRAPARTIDA SWAP

| CONDICIONES DOCUMENTACIÓN | | | | |
|---------------------------|------------------------|-------------|-------------------|---------------------|
| AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
| | Largo plazo | Corto plazo | | |
| MOODY'S | A1 | N/A | 30 | Hábiles |
| CON COLATERAL | N/A | N/A | | |

| RATING CONTRAPARTIDA | | | | | |
|---------------------------------------|-------------------------|------------------------|-------------|------------------|-------------------|
| ENTIDAD CONTRAPARTIDA | AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE | | TRIGGER ACTIVADO | PLAZO SUBSANACIÓN |
| | | Largo plazo | Corto plazo | | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. | MOODY'S | A3 | P-2 | SI | N/A |
| | CON COLATERAL | | | NO | N/A |

| * NOTAS | | | | |
|--|--|--|--|--|
| <i>MOODY'S: Se ha establecido un depósito en garantía de las obligaciones de la Entidad de Contrapartida de Swap</i> | | | | |

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

SIN ACTUACIONES PENDIENTES