

ESTADO S.05.3

AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

CUADRO A: INFORMACIÓN SOBRE LAS MEJORAS CREDITICIAS DEL FONDO

CONTRAPARTIDAS Y RATINGS

	SITUACIÓN ACTUAL										SITUACIÓN CIERRE ANUAL ANTERIOR										SITUACIÓN INICIAL																												
	1.3 DENOMINACIÓN	1.4 RATING DE LA CONTRAPARTIDA				1.5 RATING REQUERIDO DE LA CONTRAPARTIDA						1.3 DENOMINACIÓN	1.4 RATING DE LA CONTRAPARTIDA				1.5 RATING REQUERIDO DE LA CONTRAPARTIDA						1.3 DENOMINACIÓN	1.4 RATING DE LA CONTRAPARTIDA				1.5 RATING REQUERIDO DE LA CONTRAPARTIDA																					
		Moody's	Fitch	S&P	DBRS	Moody's	Fitch	S&P	DBRS	Moody's	Fitch		S&P	DBRS	Moody's	Fitch	S&P	DBRS	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																		
CONTRAPARTIDA FONDO DE RESERVA	KUTXABANK, S.A.	A3	P-2	BBB+	F2	BBB	A-2	NO APLICA	NO APLICA	N/A	N/A	A	F1	N/A	N/A	N/A	N/A	KUTXABANK, S.A.	Baa1	P-2	BBB+	F2	BBB	A-2	NO APLICA	NO APLICA	N/A	N/A	A	F1	N/A	N/A	N/A	N/A	CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SEBASTIÁN	N/A	N/A	NR	NR	A+	A-1	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/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 Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4624965
				12 de abril de 2022
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4589872
				13 de enero de 2022
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4562471
				13 de octubre de 2021
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Modificación al alza de la Serie B de A (sf) a A+ (sf) por parte de Fitch Ratings	4546833 30 de julio de 2021
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4538600 13 de julio de 2021
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4494259 13 de abril de 2021
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Modificación al alza de la serie B de A a AA- y de la serie C de B- a B+, por parte de Standard and Poors	4487773 24 de marzo de 2021
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4460947 13 de enero de 2021
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4433407 13 de octubre de 2020
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4411224 13 de julio de 2020
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Modificación a la baja de la serie C de B a B-, por parte de Standard and Poors	4400964 3 de junio de 2020
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Modificación al alza de la serie B de A- a A y de la serie C de CCC+ a B, por parte de Standard and Poors	4392824 28 de abril de 2020
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Modificación a la baja de la serie C de B a B-, por parte de Fitch Ratings	4388868 24 de abril de 2020
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4382337 8 de abril de 2020
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4357710 13 de enero de 2020
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4336953 11 de octubre de 2019
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4314811 11 de julio de 2019

FONDO	FECHA DE CONSTITUCIÓN	RATING	DESCRIPCIÓN	HECHO RELEVANTE - CNMV
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Modificación al alza de la serie C de CCC a B, por parte de Fitch Ratings	4307942 30 de mayo de 2019
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4286876 11 de abril de 2019
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4256916 11 de enero de 2019
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Modificación al alza de la serie A de AA+ a AAA y de la serie B de BB+ a A, por parte de Fitch Ratings.	4250844 11 de diciembre de 2018
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4233945 10 de octubre de 2018
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Modificación al alza de la serie A de AA a AAA y de la serie B de BBB a A-, por parte de Standard and Poors	4220595 26 de julio de 2018
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4211178 12 de julio de 2018
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4177887 12 de abril de 2018
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Modificación a la baja de la serie B de BBB+ a BBB, por parte de Standard and Poors.	4173468 22 de marzo de 2018
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Modificación al alza de la serie A de A a AA+ y de la serie B de BB a BB+, por parte de Fitch Ratings.	4163957 23 de febrero de 2018
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4150600 16 de enero de 2018
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4128881 17 de octubre de 2017
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4108003 13 de julio de 2017
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Modificación a la alza del tramo A de AA-(sf) a AA (sf) y del tramo B de BB (sf) a BBB+ (sf), por parte de Fitch Ratings	4081631 25 de abril de 2017
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4076454 12 de abril de 2017
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4049687 12 de enero de 2017
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4029682 13 de octubre de 2016
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	4008485 13 de julio de 2016
AyT Kutxa Hipotecario II FTA	12/02/2007		Fijación tipo de los bonos	3732430 13 de abril de 2016

MODIFICACIONES ESCRITURA

	Fecha Modificación	Estipulaciones modificadas
AyT KUTXA HIPOTECARIO II	25/03/2011	INCORPORACION DE LOS NUEVOS CRITERIOS DE S&P A LA ESCRITURA DE CONSTITUCIÓN, CAMBIO DE AGENTE FINANCIERO, ESTIPULACIONES 18.1, 18.5.3 Y MODIFICACIÓN DEL CONTRATO DE SERVICIOS FINANCIEROS Y DE SWAP
AyT KUTXA HIPOTECARIO II	16/04/2013	ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE. ESTIPULACIÓN 18.5.3 MODIFICACIÓN CONTRATO SWAP
AyT KUTXA HIPOTECARIO II	22/12/2015	ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE. ESTIPULACIÓN 18.1. MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN DE SERVICIOS FINANCIEROS