

ESTADO S.05.3

El ESTADO S.05.3 no está cumplimentado al no existir MEJORAS CREDITICIAS ni CONTRAPARTIDAS a nivel del Fondo. Este Fondo es un Fondo Compartimentado, compuesto por compartimentos estancos. Las Mejoras Crediticias y Contrapartidas existen a nivel de cada uno de los Compartimentos, ya que no son solidarios, al responder únicamente, para cada Compartimento concreto.

Para conocer las distintas MEJORAS CREDITICIAS y CONTRAPARTIDAS que aplican a los Compartimentos que componen el Fondo, VER ESTADO S.05.4 DE CADA UNO DE LOS COMPARTIMENTOS.

ESTADO S.05.4

El Apartado de “TRIGGERS” del ESTADO S.05.4 no está cumplimentado al no existir Triggers a nivel del Fondo. Este Fondo es un Fondo Compartimentado, compuesto por compartimentos estancos. Los Triggers existen a nivel de cada uno de los Compartimentos, ya que no son solidarios, y únicamente son aplicables a cada Compartimento concreto.

Para conocer los distintos TRIGGERS que afectan a los Compartimentos que componen el Fondo, VER ESTADO S.05.4 DE CADA UNO DE LOS COMPARTIMENTOS.

HECHOS RELEVANTES

| FONDO | FECHA DE CONSTITUCIÓN | RATING | DESCRIPCIÓN | HECHO RELEVANTE - CNMV |
|-------------------------------|-----------------------|---|---|---|
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004 | | Rebaja de la calificación de los Tramos CH2 , de <i>Baa1(sf)</i> a <i>Baa3(sf)</i> , y PH2 , de <i>Baa3(sf)</i> a <i>Ba3(sf)</i> por parte de Moody's. | Nº 2432844 14/05/2013 |
| 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 18/07/2012 |
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004 | | Rebaja de la calificación del Tramo CH1 de <i>Aa2(sf)</i> a <i>A3(sf)</i> y Tramo PH1 de <i>Aa2(sf)</i> a <i>A3(sf)</i> por parte de Moody's, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España. | Nº 1905909 06/07/2012 |
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004 | Tramo PH1 - <i>Aa2(sf)/AA-sf</i> Tramo PH2 - <i>Baa3(sf)/BBBsf</i> Tramo CH1 - <i>Aa2(sf)/AA-sf</i> Tramo CH2 - <i>Baa1(sf)/BBB+sf</i> | • Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos PH1 [AAAsf] y CH1 [AAAsf], como consecuencia de la rebaja de calificación de la deuda a largo plazo de España. | Nº 1870912 14 de junio de 2012 |
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004 | | • Acciones remediales efectuadas con motivo de la bajada de rating de CECA. | Nº 1758965 13 de abril de 2012 |
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004 | Tramo PH1 - <i>Aa2(sf)/AAAsf</i> Tramo PH2 - <i>Baa3(sf)/BBBsf</i> Tramo CH1 - <i>Aa2(sf)/AAAsf</i> Tramo CH2 - <i>Baa1(sf)/BBB+sf</i> | • Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos PH1 [Aaa(sf)] y CH1 [Aaa(sf)], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable a <i>Aa2(sf)</i> por parte de Moody's a la titulización española. | Nº 2226681 22/01/2013 Nº 1689639 28 de febrero de 2012 |
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004 | Tramo PH1 - <i>Aaa(sf)/AAAsf</i> Tramo PH2 - <i>Baa3(sf)/BBBsf</i> Tramo CH1 - <i>Aaa(sf)/AAAsf</i> Tramo CH2 - <i>Baa1(sf)/BBB+sf</i> | • Modificación al alza de los bonos del Tramo PH2 por parte de Fitch Ratings. | Nº 907555 8 de junio de 2011 |
| AyT Hipotecario Mixto II, FTA | 29/06/2004 | Serie PH1 - <i>Aaa/AAA</i> Serie PH2 - <i>Baa3/BBB</i> Serie CH1 - <i>Aaa/AAA</i> Serie CH2 - <i>Baa1/BBB</i> | • Transferencia de ciertos derechos y obligaciones recogidas en los Contratos de Swap de BEAR STEARNS BANK PLC a JP MORGAN CHASE BANK, N.A. como consecuencia de los procesos de reestructuración y fusión de dichas entidades. | Nº 249637 28 de julio de 2009 |
| AyT Hipotecario Mixto II, FTA | 29/06/2004 | Tramo PH1 - <i>Aaa/AAA</i> Tramo PH2 - <i>Baa3/BBB</i> Tramo CH1 - <i>Aaa/AAA</i> Tramo CH2 - <i>Baa3/BBB</i> | • Restablecimiento de la calificación de la Entidad de contrapartida (Bear Stearns Bank PLC). • Devolución del depósito. | Nº 80378 1 de agosto de 2008 |
| AyT Hipotecario Mixto II, FTA | 29/06/2004 | Tramo PH1 - <i>Aaa/AAA</i> Tramo PH2 - <i>Baa3/BBB</i> Tramo CH1 - <i>Aaa/AAA</i> Tramo CH2 - <i>Baa3/BBB</i> | • Rebaja de la calificación de la Entidad de contrapartida (Bear Stearns Bank PLC). • Garantía de JP MORGAN CHASE & CO. | Nº 55952 29 de mayo de 2008 |
| AyT Hipotecario Mixto II, FTA | 29/06/2004 | Tramo PH1 - <i>Aaa/AAA</i> Tramo PH2 - <i>Baa3/BBB</i> Tramo CH1 - <i>Aaa/AAA</i> Tramo CH2 - <i>Baa3/BBB</i> | • Rebaja de la calificación de la Entidad de contrapartida (Bear Stearns Bank PLC). • Formalización de depósito formalizado y apertura de una Cuenta de Depósito. | Nº 89219 11 de febrero de 2008 |