

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 ICO-FTVPO III FTA | 27/07/2009 | | Modificación al alza de la calificación de los Tramos A(G), B y C de <i>BBB-(sf)</i> a <i>BBB(sf)</i> de la Serie CAI, y modificación al alza de los Tramos A(G), B y C , de <i>BBB-(sf)</i> a <i>A-(sf)</i> de la Serie Caja Rioja. | Nº 2279183 19 de febrero de 2013 |
| AyT ICO-FTVPO III FTA | 27/07/2009 | | Rebaja en la calificación del Tramo A(G) de <i>AA-(sf)</i> a <i>A+(sf)</i> y Tramo B , de <i>AA-(sf)</i> a <i>A+(sf)</i> de ambas Series (CAI y Caja Rioja), por parte de Fitch Ratings. | Nº 2268551 12 de febrero de 2013 |
| AyT ICO-FTVPO III FTA | 27/07/2009 | | Acciones remediales | Nº 2204428 8 de enero de 2013 |
| AyT ICO-FTVPO III FTA - Serie CAI | 27/07/2009 | Tramo A (G) - AA-sf/BBB-sf Tramo B - AA-sf/BBB-sf Tramo C - BBB-sf/BBB-sf | Rebaja de la calificación por parte de Standard & Poor's del Tramo A(G) de <i>AA+sf</i> a <i>BBB-sf</i> , Tramo B de <i>AAsf</i> a <i>BBB-sf</i> y Tramo C de <i>Asf</i> a <i>BBB-sf</i> . | Nº 2052920 04/10/2012 |
| AyT ICO-FTVPO III FTA - Serie CAI | 27/07/2009 | | Acciones remediales efectuadas para la sustitución de la CECA como Entidad de Contrapartida de SWAP, siendo la posible entidad sustituta BNP Paribas. | Nº 1909867 09/07/2012 |
| AyT ICO-FTVPO III FTA - Serie CAI y Serie Rioja | 27/07/2009 | Serie CAI Tramo A (G) - <i>AA-sf/AA+sf</i> Tramo B - <i>AA-sf/AAsf</i> Tramo C - <i>BBB-sf/Asf</i> Serie Rioja Tramo A(G) - <i>AA-sf/AAAsf</i> Tramo B - <i>AA-sf/AAsf</i> Tramo C - <i>BBB-sf/Asf</i> | Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos A(G) [<i>AAAsf</i>] de ambas series por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la rebaja de calificación de la deuda a largo plazo de España. | Nº 1870960 14 de junio de 2012 Nº 2226681 22/01/2013 |
| AyT ICO-FTVPO III FTA - Serie CAI | 27/07/2009 | Tramo A (G) - <i>AAAsf/AA+sf</i> Tramo B - <i>AA-sf/AAsf</i> Tramo C - <i>BBB-sf/Asf</i> | Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [<i>AAAsf</i>], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable por Standard & Poor's a la titulación española. | Nº 1812453 9 de mayo de 2012 |
| AyT ICO-FTVPO III FTA - Serie Rioja | 27/07/2009 | Tramo A(G) - <i>AAAsf/AAAsf</i> Tramo B - <i>AA-sf/AAsf</i> Tramo C - <i>BBB-sf/Asf</i> | • Acciones remediales efectuadas como consecuencia de la bajada de rating de CECA. | Nº 1623420 25 de enero de 2012 |
| AyT ICO-FTVPO III FTA - Serie CAI | 27/07/2009 | Tramo A (G) - <i>AAAsf/AAAsf</i> Tramo B - <i>AA-sf/AAsf</i> Tramo C - <i>BBB-sf/Asf</i> | • Acciones remediales efectuadas como consecuencia de la bajada de rating de CECA. | Nº 1623425 25 de enero de 2012 |
| AyT ICO-FTVPO III FTA | 27/07/2009 | Tramo A (G) - <i>AAAsf/AAAsf</i> Tramo B - <i>AA-sf/AAsf</i> Tramo C - <i>BBB-sf/Asf</i> | • Bajada de calificación de Bankinter por debajod e A/F1, y en consecuencia, traslado del depósito de commingling abierto en esta Entidad a BBVA. | Nº 1322746 28 de septiembre de 2011 |
| AyT ICO-FTVPO III FTA | 27/07/2009 | Serie CAI Tramo A(G) - <i>AAAsf/AAAsf</i> Tramo B - <i>AA-sf/AAsf</i> Tramo C - <i>BBB-sf/Asf</i> Serie Caja Rioja Tramo A(G) - <i>AAAsf/AAAsf</i> Tramo B - <i>AA-sf/AAsf</i> Tramo C - <i>BBB-sf/Asf</i> | <input type="checkbox"/> Modificación del Anexo I y III del CMOF de la Serie CAI y del Contrato de Servicios Financieros del Fondo | Nº 933823 22 de junio de 2011 |
| AyT ICO-FTVPO III FTA | 27/07/2009 | Tramo A (G) - <i>AAAsf/AAAsf</i> Tramo B - <i>AA-sf/AAsf</i> Tramo C - <i>BBB-sf/Asf</i> | • Apertura de Cuenta de Depósito en Bankinter como consecuencia de bajada de rating del Administrador y firma del Suplemento del Contrato de Administración y Contrato de Regulación de movimientos de la cuenta. | Nº 911267 10 de junio de 2011 |
| AyT ICO-FTVPO III FTA | 27/07/2009 | Serie CAI Tramo A(G) - <i>AAA/AAA</i> Tramo B - <i>AA-/AA</i> Tramo C - <i>BBB-/A</i> Serie Caja Rioja Tramo A(G) - <i>AAA/AAA</i> Tramo B - <i>AA-/AA</i> Tramo C - <i>BBB-/A</i> | • Firma de <u>Escritura de modificación</u> de la Escritura de Constitución, con objeto de modificar ciertas condiciones económicas de los contratos de Préstamo Subordinado para Gastos Iniciales y de Fondo de Reserva de las Series CAI y Caja Rioja, y asimismo modificar ciertas condiciones del Contrato de Swap para ambas Series. • Resolución del Contrato de Servicios Financieros entre AyT y CECA, por cambio de Agente Financiero. • Firma nuevo Contrato Servicios Financieros entre AyT y Banesto, que pasa a ser el nuevo Agente Financiero. | Nº 559978 2 de junio de 2010 |

MODIFICACIONES ESCRITURA

| | Fecha Modificación | Estipulaciones modificadas |
|------------------------------|---------------------------|--|
| AYT ICO-FTVPO III FTA | 27 de mayo de 2010 | ESTIPULACIÓN 18.2.1, 18.2.2, 18.3.1, 18.3.2, 18.7.2 |
| AYT ICO-FTVPO III FTA | 18 de diciembre de 2012 | Serie CAI. ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE. ESTIPULACIONES 18.1, 18.7, 10 y 18.5. MODIFICACIÓN CONTRATO PRESTACIÓN DE SERVICIOS FINANCIEROS, PERMUTA FINANCIERA, ADMINISTRADOR Y ENTIDAD ACREDITANTE |