

ESTADO S.05.3
AyT Caja Murcia 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 | | | | | | | | | | | |
| | | 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 | LP | CP | LP | CP | | | | | | | | | | |
| CONTRAPARTIDA FONDO DE RESERVA | BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | NR | NR | BB | B | NR | NR | NR | NR | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | NR | NR | BB | B | NR | NR | NR | NR | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | CAJA DE AHORROS DE MURCIA | N/A | N/A | A+ | F1 | NR | NR | N/A | N/A | 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 Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4074689 5 de abril de 2017 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4048923 10 de enero de 2017 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4028079 5 de octubre de 2016 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4006433 5 de julio de 2016 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 3730653 5 de abril de 2016 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | Modificación al alza del tramo A de A-(sf) a A(sf), por parte de Standard and Poors | 3726462 15 de marzo de 2016 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | Modificación de las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación y sustitución de Agente Financiero. | 3704291 28 de diciembre de 2015 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | Modificación a la baja del tramo A de A(sf) a A-(sf), por parte de Standard and Poors | 3688427 28 de octubre de 2015 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | Apertura depósito de Commingling en garantía de las obligaciones del Administrador (BMN) | Nº 3479349 20 de febrero de 2015 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | Modificación a la baja del Tramo C de BB+(sf) a B-(sf) por parte de Standard & Poors | Nº 3350544 2 de diciembre de 2014 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | • Acciones remediales | Nº 2534512 17 de julio de 2013 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | • Rebaja de la calificación por parte de Fitch Ratings del Tramo C de BBB(sf) a BB+(sf) . | Nº 2164130 11 de diciembre de 2012 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | • Acción remedial. | Nº 2156317 5 de diciembre de 2012 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | • Acciones remediales efectuadas para la sustitución de CECA como Agente Financiero, siendo el nuevo Agente Financiero Barclays Bank PLC | Nº 1925722 18 de julio de 2012 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | • Acciones remediales efectuadas para la sustitución de la CECA como Entidad de Contrapartida de SWAP, siendo la posible entidad sustituta BNP Paribas. | Nº 1909744 9 de julio de 2012 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | Tramo A – AA-sf/Asf Tramo B – A+sf/Asf Tramo C – BBBsf/BBBsf | • Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la rebaja de calificación de la deuda a largo plazo de España. | Nº 1870713 14 de junio de 2012 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | • Acciones remediales efectuadas como consecuencia de la bajada de rating de CECA. | Nº 1759066 13 de abril de 2012 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | Tramo A – AAAsf/Asf Tramo B – A+sf/Asf Tramo C – BBBsf/BBBsf | • Rebaja en la calificación de los bonos del Tramo A [A+sf] por parte de Standard & Poor's | Nº 1740072 30 de marzo de 2012 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | | • Acciones remediales efectuadas como consecuencia de la bajada de rating de CECA. | Nº 1636762 31 de enero de 2012 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | Tramo A – AAAsf/A+sf Tramo B – A+sf/Asf Tramo C – BBBsf/BBBsf | • Modificación del Contrato de Servicios Financieros, con objeto de adecuarlos a la nueva criteria establecida por Standard & Poor's. | Nº 1323338 28 de septiembre de 2011 |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II FTA | 06/11/2006 | Tramo A – AAA/AAA Tramo B – A+/A+ Tramo C – BBB/BBB | • Suscripción Contrato Novación Modificativa no extintiva entre CECA y AyT con objeto de recoger los términos de los criterios actualmente vigentes por la Agencia de Calificación. | Nº 284724 15 de septiembre de 2009 |



MODIFICACIONES ESCRITURA

| | Fecha Modificación | Estipulaciones modificadas |
|-------------------------------------|-------------------------|--|
| AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA | 8 de julio de 2013 | ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE. ESTIPULACIÓN 18.4. MODIFICACIÓN CONTRATO SWAP |
| AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA | 22 de diciembre de 2015 | ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE. ESTIPULACIÓN 18.1, 18.7.1 Y 18.7.2 MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN DE SERVICIOS FINANCIEROS |