

ESTADO S.05.3

AyT Génova Hipotecario VIII, FTH

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 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | 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 | CAIXABANK, S.A. | A3 | P-2 | BBB+ | F2 | A+ | A-2 | A | R-1 (Low) | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | A-1 | N/A | N/A | CAIXABANK, S.A. | A3 | P-2 | BBB+ | F2 | BBB+ | A-2 | A | R-1 (Low) | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | A-1 | N/A | N/A | BARCLAYS BANK, PLC, sucursal en España | Aa1 | P-1 | AA+ | F1+ | AA | A-1+ | 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 Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4571719 11 de noviembre de 2021 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación al alza de las series A2, B y C, por parte de Moody's Investors Service | 4550157 16 de agosto de 2021 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4550042 16 de agosto de 2021 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación a la baja de Serie D de B (sf) a B- (sf), por parte de Fitch Ratings | 4534371 30 de junio de 2021 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación al alza de las series B de AA (sf) a AAA (sf), C de A- (sf) a AA- (sf) y D de BB (sf) a BBB (sf) por parte de Fitch Ratings | 4522564 28 de mayo de 2021 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4515825 13 de mayo de 2021 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4472904 11 de febrero de 2021 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4443662 12 de noviembre de 2020 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4422329 17 de agosto de 2020 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4394258 13 de mayo de 2020 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4368850 13 de febrero de 2020 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4345694 13 de noviembre de 2019 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4324599 13 de agosto de 2019 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4301969 13 de mayo de 2019 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación al alza de la serie A2 de AA+ a AAA, por parte de Fitch Ratings | 4274594 28 de febrero de 2019 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4268761 13 de febrero de 2019 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4245061 13 de noviembre de 2018 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4222701 13 de agosto de 2018 |

| FONDO | FECHA DE CONSTITUCIÓN | RATING | DESCRIPCIÓN | HECHO RELEVANTE - CNMV |
|---------------------------------|-----------------------|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación al alza de la serie A2 de A1 a Aa3 y de la serie B de Baa3 a Baa2, por parte de Moodys. | 4209130 29 de junio de 2018 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4196358 14 de mayo de 2018 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación a la baja de la serie B de AA+ a AA, de la serie C de A+ a A y de la serie D de BB+ a B, por parte de Fitch Ratings. | 4170749 13 de marzo de 2018 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación a la baja de la serie B de AA+ a AA, de la serie C de A+ a A y de la serie D de BB+ a B, por parte de Fitch Ratings. | 4170749 13 de marzo de 2018 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4161197 14 de febrero de 2018 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4137405 14 de noviembre de 2017 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4118259 18 de agosto de 2017 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4091817 11 de mayo de 2017 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación al alza de la serie B de AA (sf) a AA+ (sf) y de la serie C de A (sf) a A+ (sf), por parte de Fitch Ratings | 4069487 14 de marzo de 2017 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4062185 21 de febrero de 2017 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación de las actuaciones a realizar por la Parte B del Contrato de Permuta Financiera de Intereses en caso de descenso de su calificación y sustitución de la Parte B del Contrato de Permuta Financiera de Intereses. | 4058246 3 de febrero de 2017 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4038464 14 de noviembre de 2016 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4018680 11 de agosto de 2016 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 4018680 11 de agosto de 2016 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación del tramo B de Ba1 (sf) a Baa3 (sf), del tramo C de B1 (sf) a Ba3 (sf) y del tramo D de Caa1 (sf) a B3 (sf), por parte de Moodys | 3751779 18 de mayo de 2016 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 3750881 13 de mayo de 2016 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fijación tipo de los bonos | 3717108 11 de febrero de 2016 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación al alza del tramo A2 de AA (sf) a AA+(sf) y del tramo B de A(sf) a AA-(sf), por parte de Standard and Poors | 3710299 26 de enero de 2016 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Fusión por Absorción de Barclays Bank S.A.U. por CaixaBank, S.A. | Nº 3651738 2 de junio de 2015 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Remuneración de la Cuenta de Tesorería | Nº 3563457 15 de abril de 2015 |

| FONDO | FECHA DE CONSTITUCIÓN | RATING | DESCRIPCIÓN | HECHO RELEVANTE - CNMV |
|---------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación al alza de la calificación de la Serie A2 de Baa1(sf) a A1(sf), de la Serie B de Ba3(sf) a Ba1(sf) y de la Serie C de B3(sf) a B1(sf), por parte de Moody's Investor Service | Nº 3432709 26 de enero de 2015 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Sustitución del Agente Financiero | Nº 3423779 21 de enero de 2015 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación a la baja de la calificación de la Serie B de AA-(sf) a A(sf), de la Serie C de A(sf) a BB+(sf) y de la Serie D de BB(sf) a B(sf) por parte de Standard & Pooors | Nº 3353814 4 de diciembre de 2014 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación al alza de la calificación de la Serie A2 de AA-(sf) a AA+(sf) y de la Serie B de AA-(sf) a AA(sf) por parte de Fitch Ratings | Nº 3273316 16 de octubre de 2014 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación al alza de la calificación de la Serie A2 de Baa3(sf) a Baa1(sf) y de la Serie B de B2(sf) a Ba3(sf) por parte de Moody's Investors Service | Nº 3273304 16 de octubre de 2014 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación a la baja de la calificación de la serie D de BBB-(sf) a BB(sf) por parte de Standard & Poor's | Nº 3144456 25 de julio de 2014 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | Modificación al alza de la calificación del bono del Tramo A2 de AA-(sf) a AA(sf) por parte de Standard & Pooors | Nº 3079157 13 de junio de 2014 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | * Rebaja de la calificación por parte de Moody's de la Serie A2 de Baa1(sf) a Baa3(sf) , Serie B de Baa1(sf) a B2(sf) , Serie C de Baa1(sf) a B3(sf) y Serie D de Ba3(sf) a Caa1(sf) | Nº 2430371 13 de mayo de 2013 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | * Rebaja de la calificación por parte de Moody's de la Serie A2 de A3(sf) a Baa1(sf) y Serie B de A3(sf) a Baa1(sf) . | Nº 2145174 28 de noviembre de 2012 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | * Rebaja de la calificación por parte de Standard & Poor's de la Serie A2 de AA+(sf) a AA-(sf) y de la Serie B de AA(sf) a AA-(sf) como consecuencia de la rebaja de calificación del Reino de España. | Nº 2070285 16 de octubre de 2012 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | | * Rebaja de la calificación del Tramo A2 de Aa2(sf) a A3(sf) y Tramo B de Aa3(sf) a A3(sf) por parte de Moody's, como consecuencia de la bajada de calificación de | Nº 1904419 5 de julio de 2012 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | Serie A2 - AA-(sf)/Aa2(sf)/AA+(sf) Serie B - AA-(sf)/Aa3(sf)/AAAsf Serie C - Asf/Baa1(sf)/Asf Serie D - BB+(sf)/Ba3(sf)/BBB-(sf) | * Rebaja de la calificación de los bonos de la Serie A2 [AAAsf] y B [AAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la rebaja de calificación de la deuda a largo plazo de España. | Nº 1870855 14 de junio de 2012 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | Serie A2 - AAAAsf/Aa2(sf)/AA+(sf) Serie B - AAAsf/Aa3(sf)/AAAsf Serie C - Asf/Baa1(sf)/Asf Serie D - BB+(sf)/Ba3(sf)/BBB-(sf) | * Rebaja de la calificación de los bonos de la Serie A2 [AAAAsf], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable por Standard & Poor's a la titulación española. | Nº 1812496 9 de mayo de 2012 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | Serie A2 - AAAAsf/Aa2(sf)/AAAsf Serie B - AAAsf/Aa3(sf)/AAAsf Serie C - Asf/Baa1(sf)/Asf Serie D - BBB-(sf)/Ba3(sf)/BB+(sf) | * Rebaja de la calificación de los bonos de la Serie A2 [AAAAsf], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable a Aa2(sf) por parte de Moody's a la titulación española. | Nº 1689456 28 de febrero de 2012 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | Serie A2 - AAA/ Aaa/AAA Serie B - A+/Aa3/AA Serie C - BBB/Baa1/A Serie D - BB/Ba3/BB+ | * Modificación del Contrato de Servicios Financieros y Anexo I del Contrato Marco de Operaciones Financieras e incorporación de un nuevo Anexo III al CMOF, con objeto de adecuar dichos contratos a la modificación de los criterios publicados por Standard & Poor's. | Nº 987532 19 de julio de 2011 |
| AyT Génova Hipotecario VIII FTH | 07/06/2006 | Serie A1 - AAA/ Aaa/AAA Serie A2 - AAA/ Aaa/AAA Serie B - A+/Aa3/AA Serie C - BBB/Baa1/A Serie D - BB/Ba3/BB+ | * Modificación al alza de la Serie C [BBB+] por parte de Fitch Ratings. | Nº 570523 28 de junio de 2010 |



MODIFICACIONES ESCRITURA

| | Fecha Modificación | Estipulaciones modificadas |
|-------------------------------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------|
| AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FTH | 30/01/2017 | ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE. ESTIPULACIÓN 18.5 CONTRATO DE PERMUTA FINANCIERA DE INTERESES |