

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 - Serie RIOJA	27/07/2009		• Modificación al alza del tramo C de BBB+(sf) a A-(sf)	3654072 15 de junio de 2015
AyT ICO-FTVPO III FTA - Serie RIOJA	27/07/2009		• Modificación al alza de los Tramos A-(sf) a A(sf) de la Serie Caja Rioja	219778 6 de marzo de 2015
AyT ICO-FTVPO III FTA	27/07/2009		Sustitución del Agente Financiero	Nº 3376364 19 de diciembre de 2014
AyT ICO-FTVPO III FTA - Serie CAI	27/07/2009		• Modificación al alza de la calificación de los Tramos A(G) , B y C de BBB-(sf) a BBB(sf) de la Serie CAI	Nº 2279183 19 de febrero de 2013
AyT ICO-FTVPO III FTA - Serie RIOJA	27/07/2009		• Modificación al alza de los Tramos A(G) , B y C , de BBB-(sf) a A-(sf) de la Serie Caja Rioja	Nº 2279183 19 de febrero de 2013
AyT ICO-FTVPO III FTA - Serie CAI	27/07/2009		• Rebaja en la calificación del Tramo A(G) de AA-(sf) a A+(sf) y Tramo B , de AA-(sf) a A+(sf) de la Serie CAI por parte de Fitch Ratings.	Nº 2268551 12 de febrero de 2013
AyT ICO-FTVPO III FTA - Serie RIOJA	27/07/2009		• Rebaja en la calificación del Tramo A(G) de AA-(sf) a A+(sf) y Tramo B , de AA-(sf) a A+(sf) de la Serie 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 AA+sf a BBB-sf , Tramo B de AAsf a BBB-sf y Tramo C de Asf a BBB-sf .	Nº 2052920 4 de octubre de 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 9 de julio de 2012
AyT ICO-FTVPO III FTA - Serie CAI	27/07/2009	Tramo A (G) – AA-sf/AA+sf Tramo B – AA-sf/AAsf Tramo C – BBB-sf/Asf	• Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos A(G) [AAAsf] 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
AyT ICO-FTVPO III FTA - Serie RIOJA	27/07/2009	Tramo A(G) – AA-sf/AAAsf Tramo B – AA-sf/AAsf Tramo C – BBB-sf/Asf	• Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos A(G) [AAAsf] 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
AyT ICO-FTVPO III FTA - Serie CAI	27/07/2009	Tramo A (G) – AAAsf/AA+sf Tramo B – AA-sf/AAsf Tramo C – BBB-sf/Asf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [AAAsf], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable por Standard & Poor's a la titulización española.	Nº 1812453 9 de mayo de 2012
AyT ICO-FTVPO III FTA - Serie RIOJA	27/07/2009	Tramo A(G) – AAAsf/AAAsf Tramo B – AA-sf/AAsf Tramo C – BBB-sf/Asf	• 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) – AAAsf/AAAsf Tramo B – AA-sf/AAsf Tramo C – BBB-sf/Asf	• 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) – AAAsf/AAAsf Tramo B – AA-sf/AAsf Tramo C – BBB-sf/Asf	• 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 - Serie CAI	27/07/2009	Tramo A(G) – AAAsf/AAAsf Tramo B – AA-sf/AAsf Tramo C – BBB-sf/Asf	• 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 - Serie RIOJA	27/07/2009	Tramo A(G) – AAAsf/AAAsf Tramo B – AA-sf/AAsf Tramo C – BBB-sf/Asf	• 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) – AAAsf/AAAsf Tramo B – AA-sf/AAsf Tramo C – BBB-sf/Asf	• 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 - Serie CAI	27/07/2009	Tramo A(G) – AAA/AAA Tramo B – AA-/AA Tramo C – BBB-/A	• 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
AyT ICO-FTVPO III FTA - Serie RIOJA	27/07/2009	Tramo A(G) – AAA/AAA Tramo B – AA-/AA Tramo C – BBB-/A	• 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
AYT ICO-FTVPO III FTA	9 de julio de 2014	SERIE CAI. ESCRITURA DE LIQUIDACIÓN