ESTADO S.05.3

AyT Hipotecario Mixto II, FTA Serie PH CUADRO A: INFORMACIÓN SOBRE LAS MEJORAS CREDITICIAS DEL FONDO

CONTRAPARTIDAS Y RATINGS

	SITUACIÓN ACTUAL									SITUACIÓN CIERRE ANUAL ANTERIOR						SITUACIÓN INICIAL											
		1.4 RATING DE LA CONTRAPARTIDA			1.5 RA	1.5 RATING REQUERIDO DE LA CONTRAPARTIDA				1.4 RATING DE LA CONTRAPARTIDA			1.5 RATIN	1.5 RATING REQUERIDO DE LA CONTRAPARTIDA				1.4 RATING DE LA CONTRAPARTIDA				1.5 RATING REQUERIDO DE LA CONTRAPARTIDA					
	1.3 DENOMINACIÓN	Moody's	Fitch	S&P	DBRS	Moody's	Fitch	S&P	DBRS	1.3 DENOMINACIÓN	Moody's	Fitch	S&P	DBRS	Moody's	Fitch	S&P	DBRS	1.3 DENOMINACIÓN	Moody's	Fitch	S&P	DBRS	Moody's	Fitch	S&P	DBRS
		LP CP	LP CP	LP CI	LP CF	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP		LP CP	LP CI	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
	BANKIA, S.A.	Baa3 P-3	BBB- F3	BBB- A-	BBB R- (high) (lov	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	BANKIA, S.A.	Ba2 NP	BBB- F	BBB- A-3	BBB R-1 (high) (low)	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	A3 P-1	NR NR	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A
CONTRAPARTIDA FONDO	KUTXABANK, S.A.	Baa3 P-3	BBB+ F2	BBB- A-	B NR NE	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	KUTXABANK, S.A.	Ba1 NP	BBB F	BBB- A-3	NR NR	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ÁLAVA	A2 P-1	A F1	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A
DE RESERVA	BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	NR NR	вв в	NR NI	NR NI	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 GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	NR NR	A- F2	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A
	CAIXABANK, S.A.	Baa2 P-2	BBB F2	BBB A-	A (low) R-	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	CAIXABANK, S.A.	Baa2 P-2	BBB F2	! BBB A-2	A (low) R-1 (Low)	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE HUELVA Y SEVILLA	NR NR	A- F2	N/A N/A	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 Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	РН	Fijación tipo de los bonos	4102259 19 de junio de 2017
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	РН	Fijación tipo de los bonos	4070156 16 de marzo de 2017
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	РН	Fijación tipo de los bonos	4045110 16 de diciembre de 2016
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	РН	Fijación tipo de los bonos	4024186 16 de septiembre de 2016
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		Modificación Escritura y sustitución Agente Financiero	4003435 21 de junio de 2016
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	РН	Fijación tipo de los bonos	4002407 16 de junio de 2016
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		Fijación tipo de los bonos	3727177 17 de marzo de 2016
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		Modificación al alza de la calificación de la Serie PH1 de A1(sf) a Aa2(sf), de la Serie CH1 de A1(sf) a Aa2(sf) y de la Serie CH2 de Baa1(sf) a A3(sf) por parte de Moody's Investors Service	3432732 26 de enero de 2015
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		Modificación al alza de la calificación de las Series PH1, CH1, CH2 por parte de Fitch Ratings	3196548 26 de agosto de 2014
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		Rebaja de la calificación de los Tramos CH2, de Baa1(sf) a Baa3(sf), y PH2, de Baa3(sf) a Ba3(sf) por parte de Moody's.	Nº 2432844 14 de mayo de 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 de julio de 2012
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004		Rebaja de la calificación del Tramo CH1 de Aa2(sf) a A3(sf) y Tramo PH1 de Aa2(sf) a A3(sf) por parte de Moody's, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	N° 1905909 6 de julio de 2012
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	Tramo PH1 – Aa2(sf)/AA-sf Tramo PH2 – Baa3(sf)/BBBsf Tramo CH1 – Aa2(sf)/AA-sf Tramo CH2 – Baa1(sf)/BBB+sf	Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos PH1 [AAAst] y CH1[AAAst], como consecuencia de la rebaja de calificación de la deuda a largo plazo de España.	N° 1905909 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.	N° 1758965 13 de abril de 2012
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	Tramo PH1 - Aa2(sf)/AAAsf Tramo PH2 - Baa3(sf)/BBBsf Tramo CH1 - Aa2(sf)/AAAsf Tramo CH2 - Baa1(sf)/BBB+sf	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 Aa2(sf) por parte de Moody's a la titulización española.	N° 1689639 28 de febrero de 2012
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	Tramo PH1 - Aaa(sf)/AAAsf Tramo PH2 - Baa3(sf)/BBBsf Tramo CH1 - Aaa(sf)/AAAsf Tramo CH2 - Baa1(sf)/BBB+sf	Modificación al alza de los bonos del Tramo PH2 por parte de Fitch Ratings.	№ 907555 8 de junio de 2011
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	Serie PH1 – Aaa/AAA Serie PH2 – Baa3/BBB Serie CH1 – Aaa/AAA Serie CH2 – Baa1/BBB	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.	N° 249637 28 de julio de 2009
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	Tramo PH1 - Aaa/AAA Tramo PH2 - Baa3/BBB Tramo CH1 - Aaa/AAA Tramo CH2 - Baa3/BBB	Restablecimiento de la calificación de la Entidad de contrapartida (Bear Stearns Bank PLC). Devolución del depósito.	N° 80378 1 de agosto de 2008
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	Tramo PH1 - Aaa/AAA Tramo PH2 - Baa3/BBB Tramo CH1 - Aaa/AAA Tramo CH2 - Baa3/BBB	Rebaja de la calificación de la Entidad de contrapartida (Bear Stearns Bank PLC). Garantía de JP MORGAN CHASE & CO.	N° 55952 29 de mayo de 2008
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	Tramo PH1 - Aaa/AAA Tramo PH2 - Baa3/BBB Tramo CH1 - Aaa/AAA Tramo CH2 - Baa3/BBB	Rebaja de la calificación de la Entidad de contrapartida (Bear Stearns Bank PLC). Formalización de depósito formalizado y apertura de una Cuenta de Depósito.	N° 89219 11 de febrero de 2008



MODIFICACIONES ESCRITURA

	Fecha Modificación	Estipulaciones modificadas
AyT Hipotecario Mixto II, FTA	17/06/2016	ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE. ESTIPULACIÓN 18.1. MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN DE SERVICIOS FINANCIEROS