

ESTADO S.05.3

AyT Génova Hipotecario XII, 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	P-1	N/A	F1	N/A	N/A	N/A	N/A	CAIXABANK, S.A.	A3	P-2	BBB+	F2	BBB+	A-2	A	R-1 (Low)	N/A	P-1	N/A	F1	N/A	N/A	N/A	N/A	BARCLAYS BANK, PLC, sucursal en España	Aa1	P-1	AA	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
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 XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4615096 11 de marzo de 2022
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4582444 13 de diciembre de 2021
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4555077 13 de septiembre de 2021
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4527117 11 de junio de 2021
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4483167 11 de marzo de 2021
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Modificación al alza de la serie B de BBB+ a A-, por parte de Fitch Ratings	4457661 22 de diciembre de 2020
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4453994 11 de diciembre de 2020
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4426744 11 de septiembre de 2020
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4404014 16 de junio de 2020
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4377233 12 de marzo de 2020
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4351781 12 de diciembre de 2019
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4329129 12 de septiembre de 2019
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4308722 13 de junio de 2019
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4278264 13 de marzo de 2019
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Modificación al alza de la serie B de BBB a BBB+, por parte de Fitch Ratings	4274599 28 de febrero de 2019
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4252028 13 de diciembre de 2018
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4229902 13 de septiembre de 2018
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Modificación al alza de la serie B de Baa2 a A3, por parte e Moodys	4209127 29 de junio de 2018
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4204725 15 de junio de 2018

FONDO	FECHA DE CONSTITUCIÓN	RATING	DESCRIPCIÓN	HECHO RELEVANTE - CNMV
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Modificación al alza de la serie A de Aa2 a Aa1, por parte de Moodys	4189923 27 de abril de 2018
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4171448 15 de marzo de 2018
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4143854 13 de diciembre de 2017
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4122526 15 de septiembre de 2017
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4102164 19 de junio de 2017
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4069492 14 de marzo de 2017
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Modificación al alza de la serie A de Aa3(sf) a Aa2 (sf) y del tramo B de Baa3 (sf) a Baa2 (sf) parte de Moodys	4065442 28 de febrero de 2017
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		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	4046706 23 de diciembre de 2016
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4044284 13 de diciembre de 2016
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Modificación al alza del tramo A-(sf) a A+(sf), por parte de Fitch	4032267 21 de octubre de 2016
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fijación tipo de los bonos	4023474 14 de septiembre de 2016
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Modificación al alza del tramo B de Ba1 (sf) a Baa3 (sf) por parte de Moodys	3751776 18 de mayo de 2016
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Modificación a la baja del tramo A de AA+(sf) a A-(sf) y del tramo B de A(sf) a BBB(sf), por parte de Fitch Ratings	3726464 15 de marzo de 2016
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Modificación de las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación y sustitución de Agente Financiero.	3725468 9 de marzo de 2016
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Modificación al alza del tramo A de A1 (sf) a Aa3 (sf) y del tramo B de Ba2 (sf) a Ba1 (sf), por parte de Moodys	3660704 13 de julio de 2015
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Fusión por Absorción de Barclays Bank S.A.U. por CaixaBank, S.A.	Nº 3651760 2 de junio de 2015
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Remuneración de la Cuenta de Tesorería	Nº 3563443 15 de abril de 2015
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Eliminación cláusula notificación deudores	Nº 3440607 29 de enero de 2015
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Modificación al alza de la calificación de la Serie A de A3(sf) a A1(sf) y de la Serie B de B1(sf) a Ba2(sf), por parte de Moody's Investor Service	Nº 3432717 26 de enero de 2015
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Sustitución del Agente Financiero	Nº 3423802 21 de enero de 2015
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Modificación al alza de la calificación de la Serie A de AA-(sf) a AA+(sf) por parte de Fitch Ratings	Nº 3409449 13 de enero de 2015

FONDO	FECHA DE CONSTITUCIÓN	RATING	DESCRIPCIÓN	HECHO RELEVANTE - CNMV
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Modificación al alza de la calificación de la Serie A de Baa3(sf) a A3(sf) y de la Serie B de B3(sf) a B1(sf) por parte de Moosy's Investors Service	Nº 3284848 23 de octubre de 2014
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		Recompra de participaciones hipotecarias y amortización anticipada de títulos	Nº 3110075 4 de julio de 2014
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		• Rebaja de la calificación por parte de Moody's de la Serie A de Baa1(sf) a Baa3(sf) y Serie B de Baa2(sf) a B3(sf) .	Nº 2371689 18 de abril de 2013
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		• Rebaja de la calificación por parte de Moody's de la Serie A de A3(sf) a Baa1(sf) y Serie B de A3(sf) a Baa2(sf) .	Nº 2145217 28 de noviembre de 2012
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008		• Rebaja de la calificación del Tramo A de Aa2(sf) a A3(sf) y Tramo B 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	Nº 1904443 5 de julio de 2012
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008	Serie A - AA-sf/Aa2(sf) Serie B - Asf/Aa2(sf)	• Rebaja de la calificación de los bonos de la Serie A [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la rebaja de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1870879 14 de junio de 2012
AyT Génova Hipotecario XII, FTH	16/07/2008	Serie A - AAAsf/Aa2(sf) Serie B - Asf/Aa2(sf)	• Rebaja de la calificación de los bonos de la Serie A [Aaa(sf)], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable a Aa2(sf) por parte de Moody's a la titulación española.	Nº 1689485 28 de febrero de 2012



MODIFICACIONES ESCRITURA

	Fecha Modificación	Estipulaciones modificadas
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	23/01/2015	MODIFICACIÓN OBLIGACIONES DE COMUNICACIÓN A LOS DEUDORES, LA CESIÓN DE LOS ACTIVOS. ESTIPULACIÓN 5,2
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	04/03/2016	ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE. ESTIPULACIÓN 18.1 Y 18.6.3. MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN DE SERVICIOS FINANCIEROS
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FTH	21/12/2016	ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE. ESTIPULACIÓN 18.5 CONTRATO DE PERMUTA FINANCIERA DE INTERESES