

ESTADO S.05.3

ALCANTARA SHORT-TERM LENDING

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	N/P																																			
CONTRAPARTE DE LA LÍNEA DE LIQUIDEZ	Citibank Europe Plc, Ireland	Aa3	P-1	A+	F1	A+	A-1	AA (low)	R-1 (middle)	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a											
ENTIDAD AVALISTA	N/P																																			