

CONTRAPARTIDAS ESTADO S.05.3

	BANKIA	A14010342
	KUTXABANK	A95653077
CONTRAPARTIDA FONDO DE RESERVA	BANCO MARE NOSTRUM	A86104189
	CAIXABANK	A08663619
CONTRAPARTIDA PERMUTA FINANCIERA TIPO DE INTERÉS	JP MORGAN	W4001407H
CONTRAPARTIDA PERMUTA FINANCIERA TIPO DE CAMBIO	N/P	
OTRAS PERMUTAS FINANCIERAS	N/P	
CONTRAPARTE DE LA LÍNEA DE LIQUIDEZ	N/P	
ENTIDAD AVALISTA	N/P	
CONTRAPARTE DEL DERIVADO DE CRÉDITO	N/P	

HECHOS RELEVANTES

FONDO	FECHA DE CONSTITUCIÓN	RATING	DESCRIPCIÓN	HECHO RELEVANTE - CNMV
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 14/05/2013
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 18/07/2012
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.	Nº 1905909 06/07/2012
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 [AAAsf] y CH1 [AAAsf], como consecuencia de la rebaja de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1870912 14 de junio 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 titulación española.	Nº 1689639 28 de febrero de 2012
AyT Hipotecario Mixto II FTA	29/06/2004	Tramo CH1 - Aaa(sf)/AAAsf Tramo CH2 - Baa3(sf)/BBBsf Tramo PH1 - Aaa(sf)/AAAsf Tramo PH2 - Baa1(sf)/BBB+sf	• Modificación al alza de los bonos del Tramo PH2 por parte de Fitch Ratings.	Nº 2226681 22/01/2013 8 de junio de 2011
AyT Hipotecario Mixto II, FTA	29/06/2004	Serie PH1 - Aaa/AAA Serie PH2 - Baa3/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.	Nº 249637 28 de julio de 2009
AyT Hipotecario Mixto II, FTA	29/06/2004	Tramo PH1 - Aaa/AAA Tramo PH2 - Baa3/BBB	• Restablecimiento de la calificación de la Entidad de contrapartida (Bear Stearns Bank PLC). • Devolución del depósito.	Nº 80378 1 de agosto de 2008
AyT Hipotecario Mixto II, FTA	29/06/2004	Tramo PH1 - Aaa/AAA Tramo PH2 - Baa3/BBB	• Rebaja de la calificación de la Entidad de contrapartida (Bear Stearns Bank PLC). • Garantía de JP MORGAN CHASE & CO.	Nº 55952 29 de mayo de 2008
AyT Hipotecario Mixto II, FTA	29/06/2004	Tramo PH1 - Aaa/AAA Tramo PH2 - 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.	Nº 89219 11 de febrero de 2008