

ESTADO S.05.3

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA Serie CCM I

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 |    | 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 |                  | LP                             | CP | LP   | CP | LP | CP |  |  |  |  |  |  |
| CONTRAPARTIDA FONDO DE RESERVA      | BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A. |                                |    |       |    |     |    |      |    |  |       |     | BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A. |                  |                                |    |       |    |     |    |      |    |  |    | CAJA DE AHORROS DE CASTILLA LA MANCHA |    |                  |                                |    |      |    |    |    |  |  |  |  |  |  |
| CONTRAPARTE DE LA LÍNEA DE LIQUIDEZ | N/P                               |                                |    |       |    |     |    |      |    |  |       |     |                                   |                  |                                |    |       |    |     |    |      |    |  |    | N/P                                   |    |                  |                                |    |      |    |    |    |  |  |  |  |  |  |
| ENTIDAD AVALISTA                    | N/P                               |                                |    |       |    |     |    |      |    |  |       |     |                                   |                  |                                |    |       |    |     |    |      |    |  |    | N/P                                   |    |                  |                                |    |      |    |    |    |  |  |  |  |  |  |



## HECHOS RELEVANTES

| FONDO  | FECHA DE CONSTITUCIÓN | RATING  | DESCRIPCIÓN  | HECHO RELEVANTE - CNMV                |
|--|-----------------------|---|--|---------------------------------------|
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA CCM I   | 28/12/2007            |   | Modificación al alza de la serie A de AA- a AA, por parte de Fitch Ratings   | 4098578<br>1 de junio de 2017         |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA CCM I   | 28/12/2007            |   | Disposiciones Continuidad del Administrador  | 4064432<br>27 de febrero de 2017      |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA CCM I   | 28/12/2007            |   | Modificación a la baja del tramo A de A-(sf) a BBB+(sf) y del tramo B de BB(sf) a B(sf), por parte de Fitch Ratings  | 4063992<br>24 de febrero de 2017      |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA CCM I   | 28/12/2007            |   | Modificación al alza del tramo A de A(sf) a AA-(sf), por parte de Fitch Ratings.   | 3747322<br>3 de mayo de 2016          |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I | 28/12/2007            |   | • Rebaja de la calificación de los Tramos <b>A</b> , de A+(sf) a <b>A-(sf)</b> , y <b>B</b> , de BBB-(sf) a <b>BB(sf)</b> por parte de Fitch Ratings.                                | Nº 2444291<br>21 de mayo de 2013      |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I | 28/12/2007            |   | • Modificación de la Escritura Complementaria y cancelación contrato swap  | Nº 2388010<br>25 de abril de 2013     |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I | 28/12/2007            |   | • Rebaja de la calificación del <b>Tramo A</b> por parte de Standard & Poor's de BBB-(sf) a <b>A(sf)</b> .   | Nº 2371352<br>18 de abril de 2013     |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I | 28/12/2007            |   | • Rebaja de la calificación del <b>Tramo A</b> por parte de Standard & Poor's de A-sf a <b>BBB-sf</b> , y del <b>mismo Tramo</b> por parte de Fitch Ratings de AA-sf a <b>A+sf</b> . | Nº 2070539<br>16 de octubre de 2012   |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I | 28/12/2007            |   | • Acción correctiva como consecuencia de la bajada de rating de CECA.  | Nº 2047788<br>1 de octubre de 2012    |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I | 28/12/2007            | Tramo A – A-sf/AA-sf<br>Tramo B – BBB-sf<br>Tramo C –CCCs<br>Tramo D – CCsf   | • Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo <b>A</b> [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.  | Nº 1872082<br>15 de junio de 2012     |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I | 28/12/2007            | Tramo A – A-sf/AAAsf<br>Tramo B – BBB-sf<br>Tramo C – CCCsf<br>Tramo D – CCsf | • Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos <b>B</b> [A-sf], <b>C</b> [Bsf] y <b>D</b> [CCCs] por parte de Fitch.   | Nº 1767500<br>18 de abril de 2012     |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I | 28/12/2007            |   | • Acciones remediales efectuadas como consecuencia de la bajada de rating de CECA.   | Nº 1759005<br>13 de abril de 2012     |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I | 28/12/2007            | Tramo A – A-sf/AAAsf<br>Tramo B – A-sf<br>Tramo C –Bsf<br>Tramo D – CCCsf     | • Acciones remediales efectuadas como consecuencia de la bajada de rating de CECA.   | Nº 1623525<br>25 de enero de 2012     |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I | 28/12/2007            | Tramo A – A-sf/AAAsf<br>Tramo B – A-sf<br>Tramo C –Bsf<br>Tramo D – CCCsf     | • Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo <b>A</b> [AAAsf] por parte de Standard & Poor's.  | Nº 1568349<br>20 de diciembre de 2011 |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I | 28/12/2007            | Tramo A – AA(sf)/AAAsf<br>Tramo B – A-sf<br>Tramo C –Bsf<br>Tramo D – CCCsf   | • Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos <b>C</b> [BB] y <b>D</b> [B] por parte de Fitch Ratings.  | Nº 815541<br>25 de abril de 2011      |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I | 28/12/2007            | Tramo A– AAA<br>Tramo B– A-<br>Tramo C– BB<br>Tramo D– B                      | • Cambio de Contrapartes en la Serie.  | Nº 630913<br>13 de octubre de 2010    |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I | 28/12/2007            | Tramo A –AAA<br>Tramo B – A-<br>Tramo C – BB<br>Tramo D – B                   | • Rebaja de la Calificación de los Bonos de los Tramos <b>B</b> , <b>C</b> y <b>D</b> .  | Nº 480563<br>17 de febrero de 2010    |
| AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I | 28/12/2007            | Tramo A - AAA<br>Tramo B - A<br>Tramo C - BBB-<br>Tramo D - BB                | • Rebaja de la calificación de la Entidad de contrapartida (CCM).<br>• Sustitución de la Entidad de contrapartida por CECA.  | Nº 115211 CD<br>12 de agosto de 2008  |



## MODIFICACIONES ESCRITURA

|  | Fecha Modificación       | Estipulaciones modificadas  |
|--|--------------------------|---|
| AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CCM I | 24 de febrero de 2011    | INCORPORACION AGENCIA RATING S&P, ESTIPULACIÓN 7.4 Y 7.5, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS Y SWAP  |
| AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CCM I | 18 de septiembre de 2012 | SUSTITUCIÓN AGENTE FINANCIERO Y CONTRAPARTIDA SWAP Y ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE. ESTIPULACIÓN 7.4 , 7.5 Y 7.6, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS, SWAP Y ADMINISTRADOR.  |
| AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CCM I | 8 de abril de 2013       | CANCELACIÓN CONTRATO SWAP, MODIFICACIÓN TIPO INTERÉS BONOS, ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE ADMINISTRADOR. ESTIPULACIONES 3.5, 7.2, 7.3, 7.5 Y 7.6. MODIFICACIÓN CONTRATO DE SWAP, ADMINISTRACIÓN, AGENTE FINANCIERO, PRÉSTAMO SUBORDINADO PARA GASTOS INICIALES Y PRÉSTAMO SUBORDINADO PARA FONDO DE RESERVA |