

## ESTADO S.05.3

El ESTADO S.05.3 no está cumplimentado al no existir MEJORAS CREDITICIAS ni CONTRAPARTIDAS a nivel del Fondo. Este Fondo es un Fondo Compartimentado, compuesto por compartimentos estancos. Las Mejoras Crediticias y Contrapartidas existen a nivel de cada uno de los Compartimentos, ya que no son solidarios, al responder únicamente, para cada Compartimento concreto.

Para conocer las distintas MEJORAS CREDITICIAS y CONTRAPARTIDAS que aplican a los Compartimentos que componen el Fondo, VER ESTADO S.05.4 DE CADA UNO DE LOS COMPARTIMENTOS.

## ESTADO S.05.4

El Apartado de “TRIGGERS” del ESTADO S.05.4 no está cumplimentado al no existir Triggers a nivel del Fondo. Este Fondo es un Fondo Compartimentado, compuesto por compartimentos estancos. Los Triggers existen a nivel de cada uno de los Compartimentos, ya que no son solidarios, y únicamente son aplicables a cada Compartimento concreto.

Para conocer los distintos TRIGGERS que afectan a los Compartimentos que componen el Fondo, VER ESTADO S.05.4 DE CADA UNO DE LOS COMPARTIMENTOS.

## HECHOS RELEVANTES

| FONDO                        | FECHA DE CONSTITUCIÓN | RATING  | DESCRIPCIÓN   | HECHO RELEVANTE - CNMV                  |
|------------------------------|-----------------------|---|---|---|
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004            |   | Modificación al alza de la calificación de las Series PH1 de A3(sf) a A1(sf) y de la Serie CH2 de Baa3(sf) a Baa1(sf) por parte de Moosy's Investors Service  | 3273173<br><br>16 de octubre de 2014    |
| 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<br><br>26 de agosto de 2014     |
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004            | Tramo CH1   | <ul style="list-style-type: none"> <li>Modificación al alza de la calificación de los bonos del Tramo CH1 por parte de Moody's como consecuencia de la modificación de calificación de la deuda a largo plazo de España</li> </ul>  | 2926792<br><br>20 de marzo de 2014      |
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004            |   | <ul style="list-style-type: none"> <li>Rebaja de la calificación de los Tramos <b>CH2</b>, de Baa1(sf) a <b>Baa3(sf)</b>, y <b>PH2</b>, de Baa3(sf) a <b>Ba3(sf)</b> por parte de Moody's.</li> </ul>   | Nº 2432844<br><br>14 de mayo de 2013    |
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004            |   | <ul style="list-style-type: none"> <li>Acciones remediales efectuadas para la sustitución de CECA como Agente Financiero, siendo el nuevo Agente Financiero Barclays Bank PLC</li> </ul>  | Nº 1925964<br><br>18 de julio de 2012   |
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004            |   | <ul style="list-style-type: none"> <li>Rebaja de la calificación del <b>Tramo CH1</b> de Aa2(sf) a <b>A3(sf)</b> y <b>Tramo PH1</b> de Aa2(sf) a <b>A3(sf)</b> por parte de Moody's, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.</li> </ul> | Nº 1905909<br><br>6 de julio de 2012    |
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004            | Tramo PH1 – Aa2(sf)/AA-sf<br>Tramo PH2 – Baa3(sf)/BBBsf<br>Tramo CH1 – Aa2(sf)/AA-sf<br>Tramo CH2 – Baa1(sf)/BBB+sf | <ul style="list-style-type: none"> <li>Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos <b>PH1</b> [AAAsf] y <b>CH1</b> [AAAsf], como consecuencia de la rebaja de calificación de la deuda a largo plazo de España.</li> </ul>   | Nº 1905909<br><br>14 de junio de 2012   |
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004            |   | <ul style="list-style-type: none"> <li>Acciones remediales efectuadas con motivo de la bajada de rating de CECA.</li> </ul>   | Nº 1758965<br><br>13 de abril de 2012   |
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004            | Tramo PH1 – Aa2(sf)/AAAsf<br>Tramo PH2 – Baa3(sf)/BBBsf<br>Tramo CH1 – Aa2(sf)/AAAsf<br>Tramo CH2 – Baa1(sf)/BBB+sf | <ul style="list-style-type: none"> <li>Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos <b>PH1</b> [Aaa(sf)] Y <b>CH1</b> [Aaa(sf)], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable a Aa2(sf) por parte de Moody's a la titulización española.</li> </ul>      | Nº 1689639<br><br>28 de febrero de 2012 |

|                              |            |   |   |                                       |
|------------------------------|------------|---|---|---------------------------------------|
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004 | Tramo PH1 – Aaa(sf)/AAAsf<br>Tramo PH2 – Baa3(sf)/BBBsf<br>Tramo CH1 – Aaa(sf)/AAAsf<br>Tramo CH2 – Baa1(sf)/BBB+sf | <ul style="list-style-type: none"> <li>• Modificación al alza de los bonos del Tramo PH2 por parte de Fitch Ratings.</li> </ul>   | Nº 907555<br><br>8 de junio de 2011   |
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004 | Serie PH1 – Aaa/AAA<br>Serie PH2 – Baa3/BBB<br>Serie CH1 – Aaa/AAA<br>Serie CH2 – Baa1/BBB                          | <ul style="list-style-type: none"> <li>• 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.</li> </ul> | Nº 249637<br><br>28 de julio de 2009  |
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004 | Tramo PH1 - Aaa/AAA<br>Tramo PH2 - Baa3/BBB<br>Tramo CH1 - Aaa/AAA<br>Tramo CH2 - Baa3/BBB                          | <ul style="list-style-type: none"> <li>• Restablecimiento de la calificación de la Entidad de contrapartida (Bear Stearns Bank PLC).</li> <li>• Devolución del depósito.</li> </ul>   | Nº 80378<br><br>1 de agosto de 2008   |
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004 | Tramo PH1 - Aaa/AAA<br>Tramo PH2 - Baa3/BBB<br>Tramo CH1 - Aaa/AAA<br>Tramo CH2 - Baa3/BBB                          | <ul style="list-style-type: none"> <li>• Rebaja de la calificación de la Entidad de contrapartida (Bear Stearns Bank PLC).</li> <li>• Garantía de JP MORGAN CHASE &amp; CO.</li> </ul>  | Nº 55952<br><br>29 de mayo de 2008    |
| AyT Hipotecario Mixto II FTA | 29/06/2004 | Tramo PH1 - Aaa/AAA<br>Tramo PH2 - Baa3/BBB<br>Tramo CH1 - Aaa/AAA<br>Tramo CH2 - Baa3/BBB                          | <ul style="list-style-type: none"> <li>• Rebaja de la calificación de la Entidad de contrapartida (Bear Stearns Bank PLC).</li> <li>• Formalización de depósito formalizado y apertura de una Cuenta de Depósito.</li> </ul>  | Nº 89219<br><br>11 de febrero de 2008 |