

CONTRAPARTIDAS ESTADO S.05.3

| | | |
|---|--------------------|-----------|
| | BANKIA | A14010342 |
| 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 | DESCRIPCIÓN | HECHO RELEVANTE CNMV |
|-------------------------------|-----------------------|---|-------------------------------------|
| 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 | • Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos PH1 [AAA sf] y CH1 [AAA sf], 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 | • 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 titulización española. | Nº 1689639 28 de febrero de 2012 |
| AyT Hipotecario Mixto II, FTA | 29/06/2004 | • 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 | • 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 | • 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 | • 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 |