

### CONTRAPARTIDAS ESTADO S.05.3

|  |                    |           |
|--|--------------------|-----------|
|  | BANCO MARE NOSTRUM | A86104189 |
| CONTRAPARTIDA FONDO DE RESERVA                   | BBVA               | A48265169 |
|  | CAIXABANK          | A08663619 |
| CONTRAPARTIDA PERMUTA FINANCIERA TIPO DE INTERÉS | CECABANK           | A86436011 |
| 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 V FTA | 18/07/2006            |   | Fijación tipo de los bonos  | 3725384<br>8 de marzo de 2016          |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            |   | Modificación de las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación y sustitución de Agente Financiero.  | 3704281<br>28 de diciembre de 2015     |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            |   | Modificación de las actuaciones a realizar por la Entidad de Contrapartida del Contrato de Swap en caso de descenso de su calificación  | Nº 3696059<br>19 de noviembre de 2015  |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            |   | Modificación al alza de la calificación de la Serie A de Baa3(sf) a Baa2(sf) y de la Serie B de B3(sf) a B2(sf), por parte de Moody's   | Nº 3477519<br>19 de febrero de 2015    |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            |   | Modificación tanto al alza como a la baja de la calificación de la Serie A de BBB-(sf) a BBB(sf), de la Serie B de BB-(sf) a B(sf) y de la Serie C de B(sf) a B-(sf), por parte de Standard & Poors | Nº 3414638<br>16 de enero de 2015      |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            |   | Modificación al alza de la calificación de la Serie A de BB+(sf) a BBB-(sf) por parte de Standard & Poors   | Nº 3196998<br>26 de agosto de 2014     |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            |   | * Rebaja de la calificación de los Tramos <b>A</b> , de Baa1(sf) a Baa3(sf), <b>B</b> , de Ba2(sf) a B3(sf) y <b>C</b> , de B3(sf) a Caa3(sf) por parte de Moody's.                                 | Nº 2447722<br>23 de mayo de 2013       |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            |   | * Acciones remediales   | Nº 2215250<br>15 de enero de 2013      |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            |   | * Rebaja de la calificación por parte de Standard & Poor's de los <b>Tramos A</b> de AA-(sf) a BB+(sf), <b>Tramo B</b> de BBB+(sf) a BB-(sf) y <b>Tramo C</b> de BB(sf) a B(sf)                     | Nº 2204404<br>8 de enero de 2013       |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            |   | * Rebaja de la calificación por parte de Moody's del <b>Tramo A</b> de A3(sf) a Baa1(sf).   | Nº 2145256<br>28 de noviembre de 2012  |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            |   | * Rebaja de la calificación por parte de Standard & Poor's del <b>Tramo A</b> de AA(sf) a AA-(sf) como consecuencia de la rebaja de calificación del Reino de España.                               | Nº 2070329<br>16 de octubre de 2012    |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            |   | * Acciones remediales efectuadas para la sustitución de CECA como Agente Financiero, siendo el nuevo Agente Financiero Barclays Bank PLC  | Nº 1925976<br>18 de julio de 2012      |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            |   | * Acciones remediales efectuadas para la sustitución de la CECA como Entidad de Contrapartida de SWAP, siendo la posible entidad sustituta BNP Paribas.   | Nº 1909817<br>9 de julio de 2012       |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            | Tramo A – A3(sf)/AAsf<br>Tramo B – Ba2(sf)/BBB+ sf<br>Tramo C – B3(sf)/BBsf | * Acciones remediales efectuadas para la sustitución de la CECA como Entidad de Contrapartida de SWAP, siendo la posible entidad sustituta BNP Paribas.   | Nº 1623485<br>25 de enero de 2012      |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            | Tramo A – A3(sf)/AAsf<br>Tramo B – Ba2(sf)/BBB+ sf<br>Tramo C – B3(sf)/BBsf | * Modificación del Contrato de Servicios Financieros, con objeto de adecuarlo a la nueva criteria establecida por Standard & Poor's   | Nº 1323218<br>28 de septiembre de 2011 |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            | Tramo A – A3(sf)/AA<br>Tramo B – Ba2(sf)/BBB+<br>Tramo C – B3(sf)/BB        | * Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos A [Aaasf], B [A1sf] y C [Baa3sf]   | Nº 868578<br>18 de mayo de 2011        |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            | Tramo A – AA(sf)/Aaa<br>Tramo B – BBB+(sf)/A1<br>Tramo C – BB(sf)/Baa3      | * Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos A [AAAsf], B [Asf] y C [BBB-sf]  | Nº 827979<br>29 de abril de 2011       |
| AyT Hipotecario Mixto V FTA | 18/07/2006            | Tramo A – Aaa/AAA<br>Tramo B – A1/A<br>Tramo C – Baa3/BBB-                  | * Suscripción Contrato Novación Modificativa no extintiva entre CECA y AyT con objeto de recoger los términos de los criterios actualmente vigentes por la Agencia de Calificación.                 | Nº 284711<br>15 de septiembre de 2009  |

**MODIFICACIONES ESCRITURA**

|                                     | <b>Fecha Modificación</b> | <b>Estipulaciones modificadas</b>  |
|-------------------------------------|---------------------------|--|
| <b>AYT MIXTO HIPOTECARIO V, FTA</b> | 06/11/2015                | ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE, ESTIPULACIONES 18,5,4. MODIFICACIÓN DEL CONTRATO DE DE PERMUTA FINANCIERA DE INTERESES.             |
| <b>AYT MIXTO HIPOTECARIO V, FTA</b> | 22/12/2015                | ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE, ESTIPULACIONES 18.1.1 y 18.1.2. MODIFICACIÓN DEL CONTRATO DE DE PRESTACIÓN DE SERVICIOS FINANCIEROS |