

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	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 [AAAsf] y CH1 [AAAsf], 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	Serie CH1 – Aaa/AAA Serie CH2 – Baa1/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 CH1 - Aaa/AAA Tramo CH2 - 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 CH1 - Aaa/AAA Tramo CH2 - 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 CH1 - Aaa/AAA Tramo CH2 - Baa3/BBB Tramo CH2 - 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