#### **ESTADO S.05.3**

# AyT Génova Hipotecario XI, FTH

CUADRO A: INFORMACIÓN SOBRE LAS MEJORAS CREDITICIAS DEL FONDO

#### CONTRAPARTIDAS Y RATINGS

	SITUACIÓN ACTUAL						SITUACIÓN CIERRE ANUAL ANTERIOR						SITUACIÓN INICIAL														
		1.4 RATING DE LA CONTRAPARTIDA					1.5 RATING REQUERIDO DE LA CONTRAPARTIDA				1.4 RATING DE LA CONTRAPARTIDA			1.5 RATING REQUERIDO DE LA CONTRAPARTIDA				1.4 RATING DE LA CONTRAPARTIDA				1.5 RATING REQUERIDO DE LA CONTRAPARTIDA					
	1.3 DENOMINACIÓN	Moody's	Fitch	S&P	DBRS	Moody's	Fitch	S&P	DBRS	1.3 DENOMINACIÓN	Moody's	Fitch	S&P	DBRS	Moody's	Fitch		DBRS	1.3 DENOMINACIÓN	Moody's		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	LP CP		LP CP	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP	LP CP
CONTRAPARTIDA FONDO DE RESERVA	CAIXABANK, S.A.	Baa2 P-2	BBB F2	BBB A-2	A (low) R-1 (Low)	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	CAIXABANK, S.A.	Baa2 P-2	BBB F2	BBB A-2	A R-1 (low) (low)	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	N/A N/A	BARCLAYS BANK, PLC, sucursal en España	N/A N/A	N/A N/A	AA A-1+	N/A N/A				
CONTRAPARTE DE LA LÍNEA DE LIQUIDEZ	N/P									N/P									N/P								
ENTIDAD AVALISTA	N/P									N/P									N/P								



### **HECHOS RELEVANTES**

FONDO	FECHA DE CONSTITUCIÓN	RATING	DESCRIPCIÓN	HECHO RELEVANTE - CNMV		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Modificación de las actuaciones a realizar por la Parte B del Contrato de Permuta Financiera de Intereses en caso de descenso de su calificación y sustitución de la Parte B del Contrato de Permuta Financiera de Intereses	4046701 23 de diciembre de 2016		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Fijación tipo de los bonos	4038466 14 de noviembre de 2016		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Modificación al alza de la serie A2 de A-(sf) a A+(sf), de la serie B de A-(sf) a A+(sf) y de la serie C de BBB+ (sf) a A (sf), por parte de Fitch Ratings.	4032270 21 de octubre de 2016		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Fijación tipo de los bonos	4018679 11 de agosto de 2016		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Fijación tipo de los bonos	3750287 12 de mayo de 2016		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Fusión por Absorción de Barclays Bank S.A.U. por Calxabank, S.A.	N° 3651754 2 de junio de 2015		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Modificación a la baja de la calificación de la Serie A2 de AA (sf) a A-(sf) y de la Serie B de A(sf) a A-(sf), por parte de Fitch Ratings	N° 3470852 16 de febrero de 2015		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Modificación a la baja de la calificación de la Serie A2 de AA(sf) a A-(sf) y de la Serie B de A-(sf) a A-(sf), por parte de Standard & Poors	N° 3450975 3 de febrero de 2015		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Acciones remediales	N° 3440598 29 de enero de 2015		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Modificación a la baja de la calificación de la Serie B de AA- (sf) a A+(sf) y de la Serie C de BBB+(sf) a BBB(sf) por parte de Standard & Poors	N° 3353807 4 de diciembre de 2014		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Modificación al alza de la calificación de la Serie D de BB(sf) a BBB(sf) por parte de Fitch Ratings	Nº 3273192		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Recompra de participaciones hipotecarias y amortización anticipada de títulos	Nº 3110070 4 de julio de 2014		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Modificación al alza de la calificación del bono del Tramo A2 de AA-(sf) a AA(sf) por parte de Standard & Poors	N° 3079165 13 de junio de 2014		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Modificación al alza de la calificación por parte de Standard & Poor's del Tramo B de A(sf) a AA-(sf).	N° 2204407 8 de enero de 2013		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		• Rebaja de la calificación por parte de Standard & Poor's de la <b>Serie A2</b> de AA+(sf) a AA-(sf) como consecuencia de la rebaja de calificación del Reino de España.	N° 2070314 16 de octubre de 2012		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Rebaja de la calificación de los bonos de la Serie A2 [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la rebaja de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1870872 14 de junio de 2012		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Rebaja de la calificación de los bonos de la Serie A2 [AAAsf], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable por Standard & Poor´s a la titulización española.	N° 1812457 9 de mayo de 2012		
AyT Génova Hipotecario XI FTH	13/12/2007		Modificación del Contrato de Servicios Financieros y     Anexos I y III del Contrato Marco de Operaciones     Financieras, con objeto de adecuar dichos contratos a la     modificación de los criterios publicados por Standard &     Poor's.	N° 987553 19 de julio de 2011		

## **MODIFICACIONES ESCRITURA**

	Fecha Modificación	Estipulaciones modificadas
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI FTH	01/12/2010	INCORPORACION AGENCIA RATING, ESTIPULACION 10 (apdo.2), 18.3, 18.4, 18.5 (inclusión de punto 6.3 y modificación del apartado 7), 18.6.3, 19.1(apdo. VII)
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI FTH	23/01/2015	ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE, ESTIPULACIONES 10.2 Y 18.6.3. MODIFICACIÓN DEL CONTRATO DE PRESTACIÓN DE SERVICIOS FINANCIEROS Y DEL CONTRATO DE ADMINISTRACIÓN.
AYT GENOVA HIPOTECARIO XI FTH	21/12/2016	ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE. ESTIPULACIÓN 18.5 CONTRATO DE PERMUTA FINANCIERA DE INTERESES