

CONTRAPARTIDAS ESTADO S.05.3

| | | |
|---|------|-----------|
| CONTRAPARTIDA FONDO DE RESERVA | N/P | |
| CONTRAPARTIDA PERMUTA FINANCIERA TIPO DE INTERÉS | CECA | G28206936 |
| | BBVA | A48265169 |
| 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 III FTA | 27/04/2005 | Tramo A – A3 Tramo B – Caa1 Valor IO – Aaa | <ul style="list-style-type: none"> Subrogación por parte de BBVA en la posición de Caja Madrid como Contrapartida del Contrato de Permuta Financiera de Intereses, todo ello como consecuencia de la bajada de rating de Caja Madrid por parte de Moody's y Standard & Poor's. | Nº 858940 13 de mayo de 2011 |
| AyT Hipotecario Mixto III FTA | 27/04/2005 | Tramo A –A3(sf) Tramo B – Caa1 (sf) | <ul style="list-style-type: none"> Rebaja de la calificación de los Tramos A [Aaa] y B [Baa3] por parte de Moody's. | Nº 751465 24 de marzo de 2011 |

ESTADO S.05.1 CUADRO A

Respecto al Tipo de Activo contemplado en el [ESTADO S.05.1 CUADRO A](#), se ha procedido a incluir la información en aquel tipo de activo que supone un porcentaje mayoritario dentro del total de la Cartera de Activos, ya que la misma está compuesta por un **81,07 %** de Participaciones Hipotecarias (PH) y un **18,93 %** de Certificados de Transmisión de Hipoteca (CH).