

## CONTRAPARTIDAS

| CONTRAPARTIDA                       | ENTIDAD   | DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD   |
|-------------------------------------|---|---|
| Agente de Pagos                     | BANCO SANTANDER, S.A.   | BANCO SANTANDER, S.A.   |
| Depositario Cuenta Tesorería        | BANCO SANTANDER, S.A.   | BANCO SANTANDER, S.A.   |
| Contrapartida Swap                  | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.   | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.   |
| Depositario Garantía Swap           | SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA  | SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA  |
| Administrador                       | MULTICEDENTE  | MULTICEDENTE  |
| Administrador                       | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA  | CAIXABANK, S.A.   |
| Administrador                       | CAIXA D'ESTALVIS COMARCAL DE MANLLEU  | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.   |
| Administrador                       | CAIXA DE CREDIT DELS ENGINYERS - CAJA DE CRÉDITO DE LOS INGENIEROS, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CRÉDITO | CAIXA DE CREDIT DELS ENGINYERS - CAJA DE CRÉDITO DE LOS INGENIEROS, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CRÉDITO |
| Depositario Reserva Commingling     | NO APLICA   | NO APLICA   |
| Back up Servicer                    | NO APLICA   | NO APLICA   |
| Acreditante Línea Liquidez          | NO APLICA   | NO APLICA   |
| Depositario Garantía Línea Liquidez | NO APLICA   | NO APLICA   |
| Avalista                            | NO APLICA   | NO APLICA   |

## ACCIONES CORRECTIVAS

### CONCLUIDAS

| ACCIÓN  | FECHA      | ENTIDAD DEPOSITARIA                   |
|---|------------|---------------------------------------|
| Subrogación de BBVA en la posición de Caja Madrid como Entidad de Contrapartida de Swap   | 10/05/2011 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. |
| Traslado Agente Financiero desde CECA a Barclays Bank PLC SE  | 17/07/2012 | BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA |
| Establecimiento de un depósito en Banco Santander en garantía de las obligaciones de BBVA como Entidad de Contrapartida de Swap   | 28/11/2012 | BANCO SANTANDER, S.A.                 |
| Traslado depositaria garantía-swap desde Banco Santander hasta SociÉTé Générale   | 19/12/2014 | SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA  |
| Traslado Cuenta Tesorería a Barclays Bank (UK)  | 08/05/2015 | BARCLAYS BANK PLC                     |
| 1ª Modificación de la Escritura de Constitución a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación por Moodys, así como permitir que se apliquen criterios más actualizados que se publiquen en el futuro. | 17/06/2016 |                                       |
| Incorporación de Banco Santander como Agente Financiero en sustitución de Barclays Bank PLC, Sucursal en España   | 17/06/2016 | BANCO SANTANDER, S.A.                 |
| Modificación de la numeración y de la remuneración aplicable a la cuenta de depósito-swap por parte de SG   | 08/07/2016 | SOCIÉTÉ GÉNÉRALE, SUCURSAL EN ESPAÑA  |

## RATING MÍNIMO CONTRAPARTIDAS EN DOCUMENTACIÓN

### AGENTE DE PAGOS / DEPOSITARIO CUENTA DE TESORERÍA

| CONDICIONES DOCUMENTACIÓN |                        |             |                   |                     |
|---------------------------|------------------------|-------------|-------------------|---------------------|
| AGENCIA DE CALIFICACIÓN   | RATING MÍNIMO EXIGIBLE |             | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
|                           | Largo plazo            | Corto plazo |                   |                     |
| MOODY'S                   | A3                     | N/A         | 30                | Naturales           |

| RATING CONTRAPARTIDA  |                         |                        |             |                  |                   |
|-----------------------|-------------------------|------------------------|-------------|------------------|-------------------|
| ENTIDAD CONTRAPARTIDA | AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE |             | TRIGGER ACTIVADO | PLAZO SUBSANACIÓN |
|                       |                         | Largo plazo            | Corto plazo |                  |                   |
| BANCO SANTANDER, S.A. | MOODY'S                 | A2                     | P-1         | NO               | N/A               |

CONTRAPARTIDA SWAP

| CONDICIONES DOCUMENTACIÓN |                        |             |                   |                     |
|---------------------------|------------------------|-------------|-------------------|---------------------|
| AGENCIA DE CALIFICACIÓN   | RATING MINIMO EXIGIBLE |             | PLAZO ACTUACIONES | HÁBILES / NATURALES |
|                           | Largo plazo            | Corto plazo |                   |                     |
| MOODY'S                   | A1                     | N/A         | 30                | Hábiles             |
| CON COLATERAL             | N/A                    | N/A         |                   |                     |

| RATING CONTRAPARTIDA                  |                         |                        |             |                  |                   |
|---------------------------------------|-------------------------|------------------------|-------------|------------------|-------------------|
| ENTIDAD CONTRAPARTIDA                 | AGENCIA DE CALIFICACIÓN | RATING MINIMO EXIGIBLE |             | TRIGGER ACTIVADO | PLAZO SUBSANACIÓN |
|                                       |                         | Largo plazo            | Corto plazo |                  |                   |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. | MOODY'S                 | A3                     | P-2         | SI               | N/A               |
|                                       | CON COLATERAL           |                        |             | NO               | N/A               |

| * NOTAS   |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|
| <i>MOODY'S: Se ha establecido un depósito en en garantía de las obligaciones de la Entidad de Contrapartida de Swap</i> |  |  |  |  |

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

SIN ACTUACIONES PENDIENTES