

CONTRAPARTIDAS ESTADO S.05.3

| | | |
|---|--------------------|-----------|
| | CAIXABANK | A08663619 |
| CONTRAPARTIDA FONDO DE RESERVA | BANCO MARE NOSTRUM | A86104189 |
| | NCG BANCO | A70302039 |
| | CAIXA ONTINYENT | G46002796 |
| 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 | CECABANK | A86436011 |
| ENTIDAD AVALISTA | ICO | Q2876002C |
| CONTRAPARTE DEL DERIVADO DE CRÉDITO | N/P | |

HECHOS RELEVANTES

| FONDO | FECHA DE CONSTITUCIÓN | RATING | DESCRIPCIÓN | HECHO RELEVANTE - CNMV |
|----------------------|-----------------------|--|--|---------------------------------------|
| AyT ICO-FTVPO I, FTA | 16/03/2009 | Tramo A(G) – Aa2(sf)/AAAsf Tramo B – Aa2(sf)/Asf Tramo C – Baa3(sf)/BBB-sf | <ul style="list-style-type: none"> Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos A(G) [Aa(sf)] y B [Aa1(sf)], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable a Aa2(sf) por parte de Moody's a la titulación española. | Nº 1689663 28 de febrero de 2012 |
| AyT ICO-FTVPO I, FTA | 16/03/2009 | Tramo A(G) – Aa2(sf)/AA-sf Tramo B – Aa2(sf)/Asf Tramo C – Baa3(sf)/BBB-sf | <ul style="list-style-type: none"> Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A(G) [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la rebaja de calificación de la deuda a largo plazo de España. | Nº 1870951 14 de junio de 2012 |
| AyT ICO-FTVPO I FTA | 16/03/2009 | Tramo A(G) – A3(sf)/AA-sf Tramo B – A3(sf)/Asf Tramo C – Baa3(sf)/BBB-sf | Rebaja de la calificación del Tramo A(G) de Aa2(sf) a A3(sf) y Tramo B 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 1905994 6 de julio de 2012 |
| AyT ICO-FTVPO I FTA | 16/03/2009 | | Acciones remediales efectuadas para la sustitución de la CECA como Entidad de Contrapartida de CMAA | Nº 1909861 9 de julio de 2012 |
| AyT ICO-FTVPO I FTA | 16/03/2009 | | Acciones remediales efectuadas para la sustitución de CECA como Agente Financiero, siendo el nuevo Agente Financiero Barclays Bank PLC | Nº 1925997 18 de julio de 2012 |
| AyT ICO-FTVPO I FTA | 16/03/2009 | Tramo A(G) – A3(sf)/AA-sf Tramo B – Baa1(sf)/Asf Tramo C – Baa3(sf)/BBB-sf | Rebaja de la calificación por parte de Moody's del Tramo B de A3(sf) a Baa1(sf). | Nº 2145269 28 de noviembre de 2012 |
| AyT ICO-FTVPO I FTA | 16/03/2009 | | Rebaja de la calificación de los Tramos B , de Baa1(sf) a Ba1(sf), y C , de Baa3(sf) a B2(sf) por parte de Moody's. | Nº 2430326 13 de mayo de 2013 |