ESTADO S.05.3

# AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

CUADRO A: INFORMACIÓN SOBRE LAS MEJORAS CREDITICIAS DEL FONDO

## CONTRAPARTIDAS Y RATINGS

| | SITUACIÓN ACTUAL | | | | | | | | | | | SITUACIÓN CIERRE ANUAL ANTERIOR | | | | | | | | | | SITUACIÓN INICIAL | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 1.3 DENOMINACIÓN | 1.4 RATING DE LA CONTRAPARTIDA | | | | | | | | 1.5 RATING REQUERIDO DE LA CONTRAPARTIDA | | | | | | | | 1.3 DENOMINACIÓN | 1.4 RATING DE LA CONTRAPARTIDA | | | | | | | | 1.5 RATING REQUERIDO DE LA CONTRAPARTIDA | | | | | | | | 1.3 DENOMINACIÓN | 1.4 RATING DE LA CONTRAPARTIDA | | | | | | | | 1.5 RATING REQUERIDO DE LA CONTRAPARTIDA | | | | | | | |
| | | Moody's | | Fitch | | S&P | | DBRS | | Moody's | | Fitch | | S&P | | DBRS | | | Moody's | | Fitch | | S&P | | DBRS | | Moody's | | Fitch | | S&P | | DBRS | | | Moody's | | Fitch | | 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 | KUTXABANK, S.A. | NO APLICA | NO APLICA | A | F1 | NO APLICA | NO APLICA | NO APLICA | NO APLICA | N/A | N/A | A | F1 | N/A | N/A | N/A | N/A | KUTXABANK, S.A. | A3 | P-2 | BBB+ | F2 | NO APLICA | NO APLICA | NO APLICA | NO APLICA | N/A | N/A | A | F1 | N/A | N/A | N/A | N/A | CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SEBASTIÁN | N/A | N/A | NR | NR | A+ | A-1 | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | N/A | 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 Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación al alza de las series B y C, por parte de Fitch Ratings | 5017628<br>11 de abril de 2025 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación al alza de la Serie B y C, por parte de S&P | 4943536<br>19 de agosto de 2024 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación al alza de la Serie B , por parte de Fitchl Ratings | 4912174<br>24 de mayo de 2024 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación al alza de la Serie C , por parte de Fitchl Ratings | 4786806<br>19 de junio de 2023 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación al alza de la Serie C a BB+(sf), por parte de S&P Global Ratings | 4757802<br>30 de marzo de 2023 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4624965<br>12 de abril de 2022 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4589872<br>13 de enero de 2022 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4562471<br>13 de octubre de 2021 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación al alza de la Serie B de A (sf) a A+ (sf) por parte de Fitch Ratings | 4546833<br>30 de julio de 2021 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4538600<br>13 de julio de 2021 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4494259<br>13 de abril de 2021 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación al alza de la serie B de A a AA- y de la serie C de B- a B+, por parte de Standard and Poors | 4487773<br>24 de marzo de 2021 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4460947<br>13 de enero de 2021 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4433407<br>13 de octubre de 2020 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4411224<br>13 de julio de 2020 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación a la baja de la serie C de B a B-, por parte de Standard and Poors | 4400964<br>3 de junio de 2020 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación al alza de la serie B de A- a A y de la serie C de CCC+ a B, por parte de Standard and Poors | 4392824<br>28 de abril de 2020 |

| FONDO | FECHA DE CONSTITUCIÓN | RATING | DESCRIPCIÓN | HECHO RELEVANTE - CNMV |
|---|---|---|---|---|
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación a la baja de la serie C de B a B-, por parte de Fitch Ratings | 4388868<br>24 de abril de 2020 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4382337<br>8 de abril de 2020 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4357710<br>13 de enero de 2020 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4336953<br>11 de octubre de 2019 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4314811<br>11 de julio de 2019 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación al alza de la serie C de CCC a B, por parte de Fitch Ratings | 4307942<br>30 de mayo de 2019 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4286876<br>11 de abril de 2019 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4256916<br>11 de enero de 2019 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación al alza de la serie A de AA+ a AAA y de la serie B de BB+ a A, por parte de Fitch Ratings. | 4250844<br>11 de diciembre de 2018 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4233945<br>10 de octubre de 2018 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modifiación al alza de la serie A de AA a AAA y de la serie B de BBB a A-, por parte de Standard and Poors | 4220595<br>26 de julio de 2018 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4211178<br>12 de julio de 2018 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4177887<br>12 de abril de 2018 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación a la baja de la serie B de BBB+ a BBB, por parte de Standard and Poors. | 4173468<br>22 de marzo de 2018 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación al alza de la serie A de A a AA+ y de la serie B de BB a BB+, por parte de Fitch Ratings. | 4163957<br>23 de febrero de 2018 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4150600<br>16 de enero de 2018 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4128881<br>17 de octubre de 2017 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4108003<br>13 de julio de 2017 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación a la alza del tramo A de AA-(sf) a AA (sf) y del tramo B de BB (sf) a BBB+ (sf), por parte de Fitch Ratings | 4081631<br>25 de abril de 2017 |

| FONDO | FECHA DE CONSTITUCIÓN | RATING | DESCRIPCIÓN | HECHO RELEVANTE - CNMV |
|---|---|---|---|---|
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4076454<br>12 de abril de 2017 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4049687<br>12 de enero de 2017 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4029682<br>13 de octubre de 2016 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 4008485<br>13 de julio de 2016 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 3732430<br>13 de abril de 2016 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación al alza del tramo A de BBB(sf) a AA-(sf), por parte de Standard and Poors | 3706967<br>15 de enero de 2016 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Fijación tipo de los bonos | 3706382<br>13 de enero de 2016 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación de las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación y sustitución de Agente Financiero. | 3704285<br>28 de diciembre de 2015 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación a la baja de la calificación de la serie A de AA-(sf) a A(sf) y de la serie B de BBB(sf) a BB(sf), por parte de Fitch Ratings | Nº 3540090<br>30 de marzo de 2015 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Siguiendo la Orientación del Banco Central Europeo (BCE/2014/31), se realiza un Suplemento al Contrato de Administración. | Nº 3492730<br>27 de febrero de 2015 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | Modificación a la baja de la calificación del Tramo A de A(sf) a BBB(sf) y del Tramo C de B-(sf) a CCC+(sf) por parte de Standard & Poors | Nº 3418817<br>19 de enero de 2015 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | • Modificación de la Escritura de constitución y del contrato de swap | Nº 2430343<br>13 de mayo de 2013 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | • Acción correctiva - Sustitución de la Entidad de Contrapartida del Swap. | Nº 2047750<br>1 de octubre de 2012 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | • Acciones remediales efectuadas para la sustitución de CECA como Agente Financiero, siendo el nuevo Agente Financiero Barclays Bank PLC | Nº 1926009<br>18 de julio de 2012 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | Tramo A – Asf/AA-sf<br>Tramo B – BBsf/BBBsf<br>Tramo C – B-sf/CCCsf | • Rebaja en la calificación de los bonos del Tramo **A** [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la bajada de rating de la deuda a largo plazo de España. | Nº 1870978<br>14 de junio de 2012 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | Tramo A – Asf/AAAsf<br>Tramo B – BBsf/BBBsf<br>Tramo C – B-sf/CCCsf | • Rebaja en la calificación de los bonos de los Tramos **A** [AAsf], **B** [BBB-sf] y **C** [Bsf] por parte de Standard & Poor's. | Nº 1739878<br>30 de marzo de 2012 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | | • Acciones remediales - Traspaso Cuenta Tesorería | Nº 1711551<br>12 de marzo de 2012 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | Tramo A – AAsf/AAAsf<br>Tramo B – BBB-sf/BBBsf<br>Tramo C – Bsf/CCCsf | • Acciones remediales efectuadas como consecuencia de la bajada de rating de CECA y Kutxa. | Nº 1623557<br>25 de enero de 2012 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | Tramo A – AAsf/AAAsf<br>Tramo B – BBB-sf/BBBsf<br>Tramo C – Bsf/CCCsf | • Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo C [Bsf] por parte de Fitch Ratings. | Nº 868601<br>18 de mayo de 2011 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | Tramo A– AA/AAA<br>Tramo B– BBB-/BBB<br>Tramo C– B/B | • Incorporación de los nuevos criterios de S&P a la Escritura de Constitución, Cambio de Agente Financiero y modificación del Contrato de Servicios Financieros y de Swap. | Nº 761755<br>29 de marzo de 2011 |

| FONDO | FECHA DE CONSTITUCIÓN | RATING | DESCRIPCIÓN | HECHO RELEVANTE - CNMV |
|---|---|---|---|---|
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | Tramo A –AAA/ AA<br>Tramo B – BBB/ BBB-<br>Tramo C – B-/B | • Rebaja de la calificación de los Tramos **A** [AAA], **B** [A] y **C** [BBB] por parte de Standard & Poor's. | Nº 605039<br>10 de agosto de 2010 |
| AyT Kutxa Hipotecario II FTA | 12/02/2007 | Tramo A –AAA/AAA<br>Tramo B – A/ BBB<br>Tramo C – BBB/B | • Rebaja de la calificación de los Tramos **B** [A] y **C** [BBB] por parte de Fitch Ratings. | Nº 570569<br>28 de junio de 2010 |

# MODIFICACIONES ESCRITURA

| | Fecha Modificación | Estipulaciones modificadas |
|---|---|---|
| **AyT KUTXA HIPOTECARIO II** | 25/03/2011 | INCORPORACION DE LOS NUEVOS CRITERIOS DE S&P A LA ESCRITURA DE CONSTITUCIÓN, CAMBIO DE AGENTE FINANCIERO, ESTIPULACIONES 18.1, 18.5.3 Y MODIFICACIÓN DEL CONTRATO DE SERVICIOS FINANCIEROS Y DE SWAP |
| **AyT KUTXA HIPOTECARIO II** | 16/04/2013 | ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE. ESTIPULACIÓN 18.5.3 MODIFICACIÓN CONTRATO SWAP |
| **AyT KUTXA HIPOTECARIO II** | 22/12/2015 | ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE. ESTIPULACIÓN 18.1. MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN DE SERVICIOS FINANCIEROS |