ESTADO S.05.3

RONDA FUNDING FT

CUADRO A: INFORMACIÓN SOBRE LAS MEJORAS CREDITICIAS DEL FONDO

CONTRAPARTIDAS Y RATINGS

	SITUACIÓN ACTUAL																	
	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	
		LP	CP	LP	CP	LP	CP	LP	CP	LP	CP	LP	CP	LP	CP	LP	CP
CONTRAPARTE DEL FONDO DE RESERVA	CECABANK	Baa1	P-2	BBB	F3	BBB+	A-2			Baa3	P3	BBB-	P3	BBB-	P3		
CONTRAPARTE DE LA LÍNEA DE LIQUIDEZ	Beka Credit SL	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	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	Nomura European Investment Limited	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a

	SITUACIÓN CIERRE ANUAL ANTERIOR																	
	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	
		LP	CP	LP	CP	LP	CP	LP	CP	LP	CP	LP	CP	LP	CP	LP	CP
CONTRAPARTE DEL FONDO DE RESERVA	CECABANK	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	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	Beka Credit SL	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	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	Nomura European Investment Limited	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a

	SITUACIÓN INICIAL																	
	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	
		LP	CP	LP	CP	LP	CP	LP	CP	LP	CP	LP	CP	LP	CP	LP	CP
CONTRAPARTE DEL FONDO DE RESERVA	CECABANK	Baa1	P-2	BBB	F3	BBB+	A-2			Baa3	P3	BBB-	P3	BBB-	P3		
CONTRAPARTE DE LA LÍNEA DE LIQUIDEZ	Beka Credit SL	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	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	Nomura European Investment Limited	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a