

HIPOCAT 9 Fondo de Titulización de Activos



Informe resumen

Fecha: 30/06/2019
Divisa: EUR

Valores emitidos: Bonos de Titulización

Fecha constitución
25/11/2005

NIF
V64006075
Sociedad Gestora
Europea de Titulización, S.G.F.T

Originador/Cedente Activos
BBVA

Administrador Activos
BBVA

Directores Emisión Bonos
Caixa Catalunya
IXIS CIB
Deutsche Bank

Aseguradores

Caixa Catalunya
IXIS CIB
Deutsche Bank
Merrill Lynch International
Barclays Bank PLC
Lehman Brothers

Agente Pago Bonos

Société Générale

Mercado Negociación

IAAF Mercado de Renta Fija

Registro Contable Bonos

Iberclear

Cuenta Tesorería

Société Générale

Permuta Intereses

BBVA

Depositario Activos

BBVA

Auditor Fondo

KPMG Auditores

Préstamo Gastos Iniciales

BBVA

Emisión de Bonos									
Serie Código ISIN	Fecha emisión Nº bonos	Nominal (Unitario Bono / Total Serie / %Factor)		Clase de interés Índice y margen Fechas de Pago	Tipo de Interés próximo cupón	Amortización		Calificación Fitch / Moody's / S&P	
		Actual	Inicial			Vencimiento Final (legal) / frecuencia	Próxima	Actual	Inicial
Serie A1 ES0345721007	25/11/2005 2.000	100.000,00 200.000.000,00		Variable Euribor 3M+0,040% 15.Ene/Abr/Jul/Oct	15/07/2019	15/07/2038 Trimestral 15.Ene/Abr/Jul/Oct	Amortizada	AAA Aaa AAA	AAA Aaa AAA
Serie A2a ES0345721015	25/11/2005 5.000	17.190,24 85.951.200,00 17,19%	100.000,00 500.000.000,00	Variable Euribor 3M+0,130% 15.Ene/Abr/Jul/Oct	0,0000% 15/07/2019 0,000000 Bruto 0,000000 Neto	15/07/2038 Trimestral 15.Ene/Abr/Jul/Oct	"Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	A+ Aa1 A-	AAA Aaa AAA
Serie A2b ES0345721023	25/11/2005 2.362	17.190,24 40.603.346,88 17,19%	100.000,00 236.200.000,00	Variable Euribor 3M+0,130% 15.Ene/Abr/Jul/Oct	0,0000% 15/07/2019 0,000000 Bruto 0,000000 Neto	15/07/2038 Trimestral 15.Ene/Abr/Jul/Oct	"Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	A+ Aa1 A-	AAA Aaa AAA
Serie B ES0345721031	25/11/2005 220	100.000,00 22.000.000,00 100,00%	100.000,00 22.000.000,00	Variable Euribor 3M+0,170% 15.Ene/Abr/Jul/Oct	0,0000% 15/07/2019 0,000000 Bruto 0,000000 Neto	15/07/2038 Trimestral 15.Ene/Abr/Jul/Oct	"Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	BBB- A+ A1	AA+ Aa2 AA
Serie C ES0345721049	25/11/2005 183	100.000,00 18.300.000,00 100,00%	100.000,00 18.300.000,00	Variable Euribor 3M+0,290% 15.Ene/Abr/Jul/Oct	0,0000% 15/07/2019 0,000000 Bruto 0,000000 Neto	15/07/2038 Trimestral 15.Ene/Abr/Jul/Oct	"Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	CC A Ba3	A+ A2 A
Serie D ES0345721056	25/11/2005 235	100.000,00 23.500.000,00 100,00%	100.000,00 23.500.000,00	Variable Euribor 3M+0,530% 15.Ene/Abr/Jul/Oct	0,2200% 15/07/2019 55,611111 Bruto 45,045000 Neto	15/07/2038 Trimestral 15.Ene/Abr/Jul/Oct	"Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	D CCC Caa3	BBB+ Baa3 BBB-
Serie E ES0345721064	25/11/2005 160	100.000,00 16.000.000,00 100,00%	100.000,00 16.000.000,00	Variable Euribor 3M+4,500% 15.Ene/Abr/Jul/Oct	4,1900% 15/07/2019 1,059,138889 Bruto 857,902500 Neto	15/07/2038 Trimestral 15.Ene/Abr/Jul/Oct	Por reducción Fondo Reserva	C C	CC Caa3 n.c.
Total		206.354.546,88	1.016.000.000,00						

Vida media y amortización final (en años) estimadas a Fecha de Pago según diferentes hipótesis de % de tasa constante de amortización anticipada o prepago (TACP)													
Serie	Amortización	Vida media	Años	% TACP Mensual									
				0,08	0,17	0,25	0,34	0,43	0,51	0,60	0,69		
			% TACP Anual equivalente										
			1,00	2,00	3,00	4,00	5,00	6,00	7,00	8,00			
Serie A2a	Con amortización opcional *	Vida media	Años	3,94	3,62	3,40	3,12	2,93	2,76	2,59	2,44		
		Amort. final	Fecha	23/03/2023	28/11/2022	06/09/2022	29/05/2022	21/03/2022	15/01/2022	17/11/2021	22/09/2021		
	Sin amortización opcional *	Vida media	Años	4,33	4,01	3,73	3,48	3,26	3,06	2,88	2,71		
		Amort. final	Fecha	11/08/2023	18/04/2023	06/01/2023	07/10/2022	17/07/2022	05/05/2022	28/02/2022	30/12/2021		
Serie A2b	Con amortización opcional *	Vida media	Años	3,94	3,62	3,40	3,12	2,93	2,76	2,59	2,44		
		Amort. final	Fecha	23/03/2023	28/11/2022	06/09/2022	29/05/2022	21/03/2022	15/01/2022	17/11/2021	22/09/2021		
	Sin amortización opcional *	Vida media	Años	4,33	4,01	3,73	3,48	3,26	3,06	2,88	2,71		
		Amort. final	Fecha	11/08/2023	18/04/2023	06/01/2023	07/10/2022	17/07/2022	05/05/2022	28/02/2022	30/12/2021		
Serie B	Con amortización opcional *	Vida media	Años	6,25	5,76	5,51	5,01	4,76	4,50	4,25	4,00		
		Amort. final	Fecha	15/07/2025	15/01/2025	15/10/2024	15/04/2024	15/01/2024	15/10/2023	15/07/2023	15/04/2023		
	Sin amortización opcional *	Vida media	Años	10,05	9,58	9,12	8,67	8,24	7,84	7,45	7,09		
		Amort. final	Fecha	30/04/2029	09/11/2028	25/05/2028	14/12/2027	11/07/2027	13/02/2027	25/09/2026	16/05/2026		
Serie C	Con amortización opcional *	Vida media	Años	6,25	5,76	5,51	5,01	4,76	4,50	4,25	4,00		
		Amort. final	Fecha	15/07/2025	15/01/2025	15/10/2024	15/04/2024	15/01/2024	15/10/2023	15/07/2023	15/04/2023		
	Sin amortización opcional *	Vida media	Años	12,00	11,58	11,17	10,74	10,33	9,92	9,52	9,14		
		Amort. final	Fecha	11/04/2031	11/11/2030	11/06/2030	07/01/2030	08/08/2029	14/03/2029	18/10/2028	31/05/2028		
Serie D	Con amortización opcional *	Vida media	Años	6,25	5,76	5,51	5,01	4,76	4,50	4,25	4,00		
		Amort. final	Fecha	15/07/2025	15/01/2025	15/10/2024	15/04/2024	15/01/2024	15/10/2023	15/07/2023	15/04/2023		
	Sin amortización opcional *	Vida media	Años	14,33	14,13	13,80	13,67	13,41	13,14	12,86	12,56		
		Amort. final	Fecha	08/09/2033	27/05/2033	07/03/2033	10/12/2032	07/09/2032	01/08/2032	18/02/2032	03/11/2031		
Serie E	Con amortización opcional *	Vida media	Años	6,25	5,76	5,51	5,01	4,76	4,50	4,25	4,00		
		Amort. final	Fecha	15/07/2025	15/01/2025	15/10/2024	15/04/2024	15/01/2024	15/10/2023	15/07/2023	15/04/2023		
	Sin amortización opcional *	Vida media	Años	15,76	15,76	15,76	15,76	15,76	15,76	15,76	15,76		
		Amort. final	Fecha	15/01/2035	15/01/2035	15/01/2035	15/01/2035	15/01/2035	15/01/2035	15/01/2035	15/01/2035		

* Ejercicio de amortización anticipada opcional cuando el saldo vivo de los activos titulizados sea inferior al 10% del saldo vivo inicial.
Hipótesis de morosidad y fallidos de los activos titulizados: 0%.

