

Informe resumen

Fecha: 30/04/2017
Divisa: EUR

Fecha constitución
27/04/2007

NIF
V85082675
Sociedad Gestora
Europea de Titulización, S.G.F.T

Originador/Cedente Activos
Bankia

Administrador Activos
Bankia

Directores Emisión Bonos
Bankia
Deutsche Bank
BNP Paribas
Société Générale

Aseguradores y Colocadores Bonos
Bankia
Deutsche Bank
BNP Paribas
Société Générale
BBVA
Banco Pastor

Agente Pago Bonos
BNP Paribas

Mercado Negociación
AIAF Mercado de Renta Fija

Registro Contable Bonos
Iberclear

Cuenta Tesorería
Citibank

Cuenta Amortización
Bankia

Préstamo Gastos Iniciales
Bankia

Permuta Intereses
BNP Paribas

Depositarario Activos
Bankia

Audidores Fondo
Deloitte (ejercicios 2009 a actual)
Ernst & Young (hasta ejercicio 2008)

Valores emitidos: Bonos de Titulización

| Emisión de Bonos | | | | | | | | | |
|--------------------------|---------------------------|--|--------------------------------|---|--|--|--|-----------------|--------------|
| Serie Código ISIN | Fecha emisión Nº bonos | Nominal (Unitario Bono / Total Serie / %Factor) | | Clase de interés Índice y márgen Fechas de Pago | Tipo de Interés próximo cupón | Amortización | | Calificación | |
| | | Actual | Inicial | | | Vencimiento Final (legal) / frecuencia | Próxima | Actual | Inicial |
| Serie A1 ES0361797006 | 04/05/2007 3.000 | 0,00 0,00 0,00% | 100.000,00 300.000.000,00 | Variable Euribor 3M+0,050% 23.Ene/Abr/Jul/Oct | | 23/07/2050 Trimestral 23.Ene/Abr/Jul/Oct | Amortizada | AAA Aaa | |
| Serie A2 ES0361797014 | 04/05/2007 11.821 | 37.965,68 448.792.303,28 37,97% | 100.000,00 1.182.100.000,00 | Variable Euribor 3M+0,150% 23.Ene/Abr/Jul/Oct | 0,0000% 24/07/2017 0,000000 Bruto 0,000000 Neto | 23/07/2050 Trimestral 23.Ene/Abr/Jul/Oct | A Determinar "Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias | A+sf Aa3sf | AAA Aaa |
| Serie A3 ES0361797022 | 04/05/2007 3.000 | 5.565,55 16.696.650,00 5,57% | 100.000,00 300.000.000,00 | Variable Euribor 3M+0,170% 23.Ene/Abr/Jul/Oct | 0,0000% 24/07/2017 0,000000 Bruto 0,000000 Neto | 23/07/2050 Trimestral 23.Ene/Abr/Jul/Oct | A Determinar "Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias | A+sf Aa3sf | AAA Aaa |
| Serie B ES0361797030 | 04/05/2007 305 | 100.000,00 30.500.000,00 100,00% | 100.000,00 30.500.000,00 | Variable Euribor 3M+0,220% 23.Ene/Abr/Jul/Oct | 0,0000% 24/07/2017 0,000000 Bruto 0,000000 Neto | 23/07/2050 Trimestral 23.Ene/Abr/Jul/Oct | A Determinar "Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias | BBB-sf Ba2sf | AA Aa3 |
| Serie C ES0361797048 | 04/05/2007 189 | 100.000,00 18.900.000,00 100,00% | 100.000,00 18.900.000,00 | Variable Euribor 3M+0,330% 23.Ene/Abr/Jul/Oct | 0,0000% 24/07/2017 0,000000 Bruto 0,000000 Neto | 23/07/2050 Trimestral 23.Ene/Abr/Jul/Oct | A Determinar "Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias | BBsf B2sf | A+ A3 |
| Serie D ES0361797055 | 04/05/2007 185 | 100.000,00 18.500.000,00 100,00% | 100.000,00 18.500.000,00 | Variable Euribor 3M+0,580% 23.Ene/Abr/Jul/Oct | 0,2480% 24/07/2017 62,688889 Bruto 50,778000 Neto | 23/07/2050 Trimestral 23.Ene/Abr/Jul/Oct | A Determinar "Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias | Bsf Casf | BBB+ Baa3 |
| Serie E ES0361797063 | 04/05/2007 231 | 100.000,00 23.100.000,00 100,00% | 100.000,00 23.100.000,00 | Variable Euribor 3M+4,000% 23.Ene/Abr/Jul/Oct | 3,6680% 24/07/2017 927,188889 Bruto 751,023000 Neto | 23/07/2050 Trimestral 23.Ene/Abr/Jul/Oct | A Determinar Por reducción Fondo Reserva | CC Csf | CCC Caa3 |
| Total | | 556.488.953,28 | 1.873.100.000,00 | | | | | | |

| Vida media y amortización final (en años) estimadas según diferentes hipótesis de % de tasa constante de amortización anticipada o prepago (TACP) | | | | | | | | | | | |
|---|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Serie | Con amortización opcional * | Vida media | % TACP Mensual | | | | | | | | |
| | | | Años | 0,25 | 0,34 | 0,42 | 0,51 | 0,60 | 0,69 | 0,78 | 0,87 |
| | | % TACP Anual equivalente | | 3,00 | 4,00 | 5,00 | 6,00 | 7,00 | 8,00 | 9,00 | 10,00 |
| Serie A2 | Con amortización opcional * | Años | 5,00 | 4,68 | 4,39 | 4,11 | 3,91 | 3,66 | 3,49 | 3,32 | |
| | | Fecha | 21/04/2022 | 27/12/2021 | 11/09/2021 | 02/06/2021 | 20/03/2021 | 20/12/2020 | 17/10/2020 | 18/08/2020 | |
| | Sin amortización opcional * | Años | 8,50 | 8,00 | 7,50 | 7,00 | 6,75 | 6,25 | 5,75 | 5,25 | |
| | | Fecha | 23/10/2025 | 23/04/2025 | 23/10/2024 | 23/04/2024 | 23/01/2024 | 23/07/2023 | 23/04/2023 | 23/01/2023 | |
| | Serie A3 | Con amortización opcional * | Años | 0,33 | 0,32 | 0,30 | 0,29 | 0,28 | 0,26 | 0,25 | 0,25 |
| | | | Fecha | 23/08/2017 | 18/08/2017 | 12/08/2017 | 07/08/2017 | 02/08/2017 | 28/07/2017 | 23/07/2017 | 23/07/2017 |
| Sin amortización opcional * | | Años | 0,50 | 0,50 | 0,50 | 0,50 | 0,50 | 0,50 | 0,50 | 0,50 | |
| | | Fecha | 23/10/2017 | 23/10/2017 | 23/10/2017 | 23/10/2017 | 23/10/2017 | 23/10/2017 | 23/10/2017 | 23/07/2017 | |
| Serie B | | Con amortización opcional * | Años | 8,50 | 8,00 | 7,50 | 7,00 | 6,75 | 6,25 | 6,00 | 5,75 |
| | | | Fecha | 23/10/2025 | 23/04/2025 | 23/10/2024 | 23/04/2024 | 23/01/2024 | 23/07/2023 | 23/04/2023 | 23/01/2023 |
| | Sin amortización opcional * | Años | 14,28 | 13,71 | 13,17 | 12,66 | 12,15 | 11,66 | 11,17 | 10,71 | |
| | | Fecha | 01/08/2031 | 06/01/2031 | 23/06/2030 | 17/12/2029 | 16/06/2029 | 16/12/2028 | 23/06/2028 | 05/01/2028 | |
| | Serie C | Con amortización opcional * | Años | 8,50 | 8,00 | 7,50 | 7,00 | 6,75 | 6,25 | 6,00 | 5,75 |
| | | | Fecha | 23/10/2025 | 23/04/2025 | 23/10/2024 | 23/04/2024 | 23/01/2024 | 23/07/2023 | 23/04/2023 | 23/01/2023 |
| Sin amortización opcional * | | Años | 16,59 | 16,08 | 15,51 | 14,95 | 14,41 | 13,90 | 13,41 | 12,95 | |
| | | Fecha | 21/11/2033 | 11/05/2033 | 22/10/2032 | 01/04/2032 | 17/09/2031 | 15/03/2031 | 18/09/2030 | 01/04/2030 | |
| Serie D | | Con amortización opcional * | Años | 8,50 | 8,00 | 7,50 | 7,00 | 6,75 | 6,25 | 6,00 | 5,75 |
| | | | Fecha | 22/10/2025 | 23/04/2025 | 22/10/2024 | 22/04/2024 | 23/01/2024 | 23/07/2023 | 23/04/2023 | 23/01/2023 |
| | Sin amortización opcional * | Años | 20,25 | 19,72 | 19,21 | 18,72 | 18,23 | 17,74 | 17,26 | 16,77 | |
| | | Fecha | 19/07/2037 | 07/01/2037 | 05/07/2036 | 06/01/2036 | 12/07/2035 | 15/01/2035 | 22/07/2034 | 27/01/2034 | |
| | Serie E | Con amortización opcional * | Años | 8,50 | 8,00 | 7,50 | 7,00 | 6,75 | 6,25 | 6,00 | 5,75 |
| | | | Fecha | 23/10/2025 | 23/04/2025 | 23/10/2024 | 23/04/2024 | 23/01/2024 | 23/07/2023 | 23/04/2023 | 23/01/2023 |
| Sin amortización opcional * | | Años | 29,52 | 29,52 | 29,52 | 29,52 | 29,52 | 29,52 | 29,52 | 29,52 | |
| | | Fecha | 23/10/2046 | 23/10/2046 | 23/10/2046 | 23/10/2046 | 23/10/2046 | 23/10/2046 | 23/10/2046 | 23/10/2046 | |

* 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 fallos de los activos titulizados: 0%.

