

Informe resumen

Fecha: 31/08/2017
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

Auditores 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	37.623,86 444.751.649,06 37,62%	100.000,00 1.182.100.000,00	Variable Euribor 3M+0,150% 23.Ene/Abr/Jul/Oct	0,0000% 23/10/2017 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	1.524,90 4.574.700,00 1,52%	100.000,00 300.000.000,00	Variable Euribor 3M+0,170% 23.Ene/Abr/Jul/Oct	0,0000% 23/10/2017 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% 23/10/2017 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% 23/10/2017 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% 23/10/2017 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% 23/10/2017 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		540.326.349,06 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								
			Años	3,00	4,00	5,00	6,00	7,00	8,00	9,00	10,00
Serie A2	Con amortización opcional *	Años	4,73	4,50	4,22	4,02	3,77	3,60	3,43	3,22	
		Fecha	16/04/2022	19/01/2022	10/10/2021	28/07/2021	30/04/2021	25/02/2021	27/12/2020	10/10/2020	
	Sin amortización opcional *	Años	5,28	4,98	4,70	4,45	4,22	4,01	3,82	3,64	
		Fecha	01/11/2022	14/07/2022	04/04/2022	02/01/2022	11/10/2021	26/07/2021	17/05/2021	14/03/2021	
	Serie A3	Con amortización opcional *	Años	0,25	0,25	0,25	0,25	0,25	0,25	0,25	0,25
			Fecha	23/10/2017	23/10/2017	23/10/2017	23/10/2017	23/10/2017	23/10/2017	23/10/2017	23/10/2017
Sin amortización opcional *		Años	0,25	0,25	0,25	0,25	0,25	0,25	0,25	0,25	
		Fecha	23/10/2017	23/10/2017	23/10/2017	23/10/2017	23/10/2017	23/10/2017	23/10/2017	23/10/2017	
Serie B		Con amortización opcional *	Años	8,00	7,75	7,25	7,00	6,50	6,25	6,00	5,50
			Fecha	23/07/2025	23/04/2025	23/10/2024	23/07/2024	23/01/2024	23/10/2023	23/07/2023	23/01/2023
	Sin amortización opcional *	Años	14,03	13,48	12,95	12,46	11,97	11,49	11,03	10,58	
		Fecha	30/07/2031	10/01/2031	04/07/2030	03/01/2030	10/07/2029	17/01/2029	11/07/2028	17/02/2028	
	Serie C	Con amortización opcional *	Años	8,00	7,75	7,25	7,00	6,50	6,25	6,00	5,50
			Fecha	23/07/2025	23/04/2025	23/10/2024	23/07/2024	23/01/2024	23/10/2023	23/07/2023	23/01/2023
Sin amortización opcional *		Años	16,34	15,82	15,28	14,74	14,22	13,72	13,24	12,79	
		Fecha	20/11/2033	14/05/2033	31/10/2032	17/04/2032	08/10/2031	08/04/2031	18/10/2030	06/05/2030	
Serie D		Con amortización opcional *	Años	8,00	7,75	7,25	7,00	6,50	6,25	6,00	5,50
			Fecha	23/07/2025	22/04/2025	22/10/2024	22/07/2024	22/01/2024	23/10/2023	23/07/2023	22/01/2023
	Sin amortización opcional *	Años	20,00	19,48	18,96	18,50	17,55	17,07	16,60	16,60	
		Fecha	19/07/2037	11/01/2037	13/07/2036	18/01/2036	27/07/2035	04/02/2035	15/08/2034	24/02/2034	
	Serie E	Con amortización opcional *	Años	8,00	7,75	7,25	7,00	6,50	6,25	6,00	5,50
			Fecha	23/07/2025	23/04/2025	23/10/2024	23/07/2024	23/01/2024	23/10/2023	23/07/2023	23/01/2023
Sin amortización opcional *		Años	29,27	29,27	29,27	29,27	29,27	29,27	29,27	29,27	
		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%.

