

Informe resumen

Fecha: 31/08/2018
Divisa: EUR

Valores emitidos: Bonos de Titulización

Fecha constitución
26/05/2006

NIF
V84722446

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

Originador/Cedente Activos

Caixa Popular - Caixa Rural
Caixa Rural de Baleares
Caixa Rural de Aragón
Caixa Rural de Burgos
Caixa Rural de Canarias
Caixa Rural de Ciudad Real
Caixa Rural de Córdoba
Caixa Rural de Extremadura
Caixa Rural de Granada
Caixa Rural de Navarra
Caixa Rural de Tenerife
Caixa Rural de Teruel
Caixa Rural de Zamora
Caixa Rural del Duero
Caixa Rural del Mediterráneo,
Ruralcaja
Caixa Rural del Sur

Administrador Activos

Caixa Popular-Caixa Rural
Caixa Rural de Baleares
Caixa Rural de Aragón
Caixa Rural de Burgos
Caixa Rural de Canarias
Caixa Rural de Ciudad Real
Caixa Rural de Córdoba
Caixa Rural de Extremadura
Caixa Rural de Granada
Caixa Rural de Navarra
Caixa Rural de Tenerife
Caixa Rural de Teruel
Caixa Rural de Zamora
Caixa Rural del Duero
Caixa Rural del Mediterráneo,
Ruralcaja
Caixa Rural del Sur

Directores Emisión Bonos

Banco Cooperativo
Deutsche Bank
Dexia Capital Markets
DZ Bank AG

Aseguradores y Colocadores Bonos

Banco Cooperativo
Deutsche Bank
Dexia Capital Markets
DZ Bank
ING
Bankia
Banco Popular
Banco Santander Central Hispano
CAM

Asegurador y Colocador Senior

ING

Garante Administrador

Banco Cooperativo Español

Agente Pago Bonos

Société Générale

Mercado Negociación

AIAF Mercado de Renta Fija

Registro Contable Bonos

Iberclear

Cuenta Tesorería

Société Générale

Permuta Intereses

Banco Cooperativo

Préstamo Gastos Iniciales

Caixa Popular-Caixa Rural
Caixa Rural de Baleares
Caixa Rural de Aragón
Caixa Rural de Burgos
Caixa Rural de Canarias
Caixa Rural de Ciudad Real
Caixa Rural de Córdoba
Caixa Rural de Extremadura
Caixa Rural de Granada
Caixa Rural de Navarra
Caixa Rural de Tenerife
Caixa Rural de Teruel
Caixa Rural de Zamora
Caixa Rural del Duero
Caixa Rural del Mediterráneo, Ruralcaja
Caixa Rural del Sur

Depositario Activos

Banco Cooperativo Español

Audidores Fondo

KPMG Auditores

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	
		Actual	Inicial			Vencimiento Final (legal) / frecuencia	Próxima	Actual	Inicial
Serie A1 ES0366367003	31/05/2006 975	100.000,00	97.500.000,00	Variable Euribor 3M+0,050% 19.Ene/Abr/Jul/Oct	19/10/2018 Bruto Neto	19/01/2044 Trimestral 19.Ene/Abr/Jul/Oct	Predefinida	AAA Aaa	AAA Aaa
Serie A2a ES0366367011	31/05/2006 8.024	20.698,14 166.081.875,36 20,70%	100.000,00 802.400.000,00	Variable Euribor 3M+0,130% 19.Ene/Abr/Jul/Oct	0,0000% 19/10/2018 0,000000 Bruto 0,000000 Neto	19/01/2044 Trimestral 19.Ene/Abr/Jul/Oct	19/10/2018 "Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	AAAsf Aa1	AAA Aaa
Serie A2b ES0366367029	31/05/2006 3.500	20.698,14 72.443.490,00 20,70%	100.000,00 350.000.000,00	Variable Euribor 3M+0,140% 19.Ene/Abr/Jul/Oct	0,0000% 19/10/2018 0,000000 Bruto 0,000000 Neto	19/01/2044 Trimestral 19.Ene/Abr/Jul/Oct	19/10/2018 "Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	AAAsf Aa1	AAA Aaa
Serie B ES0366367037	31/05/2006 273	76.642,07 20.923.285,11 76,64%	100.000,00 27.300.000,00	Variable Euribor 3M+0,250% 19.Ene/Abr/Jul/Oct	0,0000% 19/10/2018 0,000000 Bruto 0,000000 Neto	19/01/2044 Trimestral 19.Ene/Abr/Jul/Oct	A determinar "Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	A+ Aa3	A+ A1
Serie C ES0366367045	31/05/2006 156	76.642,07 11.956.162,92 76,64%	100.000,00 15.600.000,00	Variable Euribor 3M+0,550% 19.Ene/Abr/Jul/Oct	0,2290% 19/10/2018 44,852643 Bruto 36,330641 Neto	19/01/2044 Trimestral 19.Ene/Abr/Jul/Oct	A Determinar "Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	A+sf Ba2	BBB Baa2
Serie D ES0366367052	31/05/2006 72	100.000,00 7.200.000,00 100,00%	100.000,00 7.200.000,00	Variable Euribor 3M+2,000% 19.Ene/Abr/Jul/Oct	1,6790% 19/10/2018 429,077778 Bruto 347,553000 Neto	19/01/2044 Trimestral 19.Ene/Abr/Jul/Oct	A Determinar "Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	Asf Caa2(sf)	BB+ Ba2
Serie E ES0366367060	31/05/2006 234	25.000,00 5.850.000,00 50,00%	50.000,00 11.700.000,00	Variable Euribor 3M+4,000% 19.Ene/Abr/Jul/Oct	3,6790% 19/10/2018 235,047222 Bruto 190,388250 Neto	19/01/2044 Trimestral 19.Ene/Abr/Jul/Oct	A Determinar Por reducción Fondo Reserva	CC Casf	CC Caa3
Total		284.454.813,39		1.311.700.000,00					

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	0,17	0,25	0,34	0,42	0,51	0,60	0,69	0,78
			% TACP Anual equivalente								
			2,00	3,00	4,00	5,00	6,00	7,00	8,00	9,00	
Serie A2a	Con amortización opcional *	Vida media	Años	4,17	3,97	3,77	3,59	3,41	3,24	3,07	2,91
	Amort. final	Años	19/09/2022	07/07/2022	26/04/2022	17/02/2022	14/12/2021	13/10/2021	13/08/2021	15/06/2021	
Sin amortización opcional *	Vida media	Años	5,77	5,51	5,27	5,04	4,83	4,64	4,46	4,29	
	Amort. final	Años	19/04/2024	19/01/2024	19/10/2023	19/07/2023	19/04/2023	19/01/2023	19/10/2022	19/07/2022	
Serie A2b	Con amortización opcional *	Vida media	Años	4,17	3,97	3,77	3,59	3,41	3,24	3,07	2,91
	Amort. final	Años	19/09/2022	07/07/2022	26/04/2022	17/02/2022	14/12/2021	13/10/2021	13/08/2021	15/06/2021	
Sin amortización opcional *	Vida media	Años	5,77	5,51	5,27	5,04	4,83	4,64	4,46	4,29	
	Amort. final	Años	19/04/2024	19/01/2024	19/10/2023	19/07/2023	19/04/2023	19/01/2023	19/10/2022	19/07/2022	
Serie B	Con amortización opcional *	Vida media	Años	2,43	2,31	2,20	2,09	1,99	1,89	1,80	1,71
	Amort. final	Años	20/12/2020	07/11/2020	28/09/2020	20/08/2020	14/07/2020	09/06/2020	05/05/2020	01/04/2020	
Sin amortización opcional *	Vida media	Años	5,76	5,51	5,25	5,00	4,75	4,51	4,25	4,00	
	Amort. final	Años	19/04/2024	19/01/2024	19/10/2023	19/07/2023	19/04/2023	19/01/2023	19/10/2022	19/07/2022	
Serie C	Con amortización opcional *	Vida media	Años	2,43	2,31	2,20	2,09	1,99	1,89	1,80	1,71
	Amort. final	Años	20/12/2020	07/11/2020	28/09/2020	20/08/2020	14/07/2020	09/06/2020	05/05/2020	01/04/2020	
Sin amortización opcional *	Vida media	Años	5,76	5,51	5,25	5,00	4,75	4,51	4,25	4,00	
	Amort. final	Años	19/04/2024	19/01/2024	19/10/2023	19/07/2023	19/04/2023	19/01/2023	19/10/2022	19/07/2022	
Serie D	Con amortización opcional *	Vida media	Años	5,76	5,51	5,25	5,00	4,75	4,51	4,25	4,00
	Amort. final	Años	19/04/2024	19/01/2024	19/10/2023	19/07/2023	19/04/2023	19/01/2023	19/10/2022	19/07/2022	
Sin amortización opcional *	Vida media	Años	15,32	15,12	14,88	14,68	14,20	13,96	13,73	13,51	
	Amort. final	Años	10/11/2033	27/08/2033	08/06/2033	19/03/2033	20/12/2032	25/09/2032	30/06/2032	05/04/2032	
Serie E	Con amortización opcional *	Vida media	Años	3,00	2,88	2,75	2,63	2,50	2,38	2,25	2,13
	Amort. final	Años	19/07/2021	04/06/2021	19/04/2021	04/03/2021	17/01/2021	03/12/2020	18/10/2020	02/09/2020	
Sin amortización opcional *	Vida media	Años	11,26	11,26	11,26	11,26	11,26	11,26	11,26	11,26	
	Amort. final	Años	19/10/2029	19/10/2029	19/10/2029	19/10/2029	19/10/2029	19/10/2029	19/10/2029	19/10/2029	

Ejercicio de Amortización anticipada opcional cuando el Saldo Vivo de los activos titulizados sea inferior al 10% del Saldo Vivo Inicial.
Hipótesis de fallos de los activos titulizados: 0%.

Información adicional

Europea de Titulización: C/ Lagasca, 120 - 28006 Madrid ☎ +34 91 411 84 67 📠 +34 91 411 84 68 🌐 www.edt-sg.es ✉ info@edt-sg.es
Registro oficial CNMV: C/ Edison, 4 - 28006 Madrid ☎ +34 91 585 15 00 🌐 www.cnmv.es

