

HIPOCAT 9 Fondo de Titulación de Activos

Informe resumen

Fecha: 30/09/2020
Divisa: EUR

Fecha constitución
 25/11/2005

NIF
 V64006075

Sociedad Gestora
 Europea de Titulación, 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
 AIAF 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

Valores emitidos: Bonos de Titulación

Emisión de Bonos										
Serie Códigos ISIN	Fecha emisión N° 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 ES0345721007	25/11/2005 2.000	100.000,00	200.000.000,00	Variable Euribor 3M+0,040% 15.Ene/Abr/Jul/Oct	15/10/2020	15/07/2038 Trimestral 15.Ene/Abr/Jul/Oct	Amortizada	AAAsf Aaa (sf) AAA (sf)	AAA Aaa AAA	
Serie A2a ES0345721015	25/11/2005 5.000	13.160,35 65.801.750,00 13,16%	100.000,00 500.000.000,00	Variable Euribor 3M+0,130% 15.Ene/Abr/Jul/Oct	0,0000% 15/10/2020 0,000000 Bruto 0,000000 Neto	15/07/2038 Trimestral 15.Ene/Abr/Jul/Oct	"Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	A+sf Aa1 (sf) AA (sf)	AAA Aaa AAA	
Serie A2b ES0345721023	25/11/2005 2.362	13.160,35 31.084.746,70 13,16%	100.000,00 236.200.000,00	Variable Euribor 3M+0,130% 15.Ene/Abr/Jul/Oct	0,0000% 15/10/2020 0,000000 Bruto 0,000000 Neto	15/07/2038 Trimestral 15.Ene/Abr/Jul/Oct	"Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	A+sf Aa1 (sf) AA (sf)	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% 15/10/2020 0,000000 Bruto 0,000000 Neto	15/07/2038 Trimestral 15.Ene/Abr/Jul/Oct	"Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	A+sf A1 (sf) A (sf)	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% 15/10/2020 0,000000 Bruto 0,000000 Neto	15/07/2038 Trimestral 15.Ene/Abr/Jul/Oct	"Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	Asf Ba3 (sf) BB (sf)	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	0,0950% 15/10/2020 24,277778 Bruto 19,665000 Neto	15/07/2038 Trimestral 15.Ene/Abr/Jul/Oct	"Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	B-sf B2 (sf) CCC (sf)	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	4,0850% 15/10/2020 1.038,833333 Bruto 841,455000 Neto	15/07/2038 Trimestral 15.Ene/Abr/Jul/Oct	Por reducción Fondo Reserva	Csf C (sf) n.c.	CC Caa3 n.c.	
Total		176.686.496,70	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)

			% 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 3,04	2,84	2,56	2,39	2,22	2,16	2,01	1,87
		Amort. final	Fecha 31/07/2023	18/05/2023	05/02/2023	04/12/2022	04/10/2022	11/09/2022	19/07/2022	28/05/2022
Serie A2b	Sin amortización opcional *	Vida media	Años 3,57	3,31	3,09	2,89	2,71	2,55	2,41	2,28
		Amort. final	Fecha 06/02/2024	06/11/2023	17/08/2023	05/06/2023	01/04/2023	01/02/2023	10/12/2022	23/10/2022
Serie B	Con amortización opcional *	Vida media	Años 4,51	4,25	3,75	3,50	3,25	3,00	2,75	2,50
		Amort. final	Fecha 15/01/2025	15/10/2024	15/04/2024	15/01/2024	15/10/2023	15/10/2023	15/07/2023	15/04/2023
Serie C	Sin amortización opcional *	Vida media	Años 8,47	8,05	7,66	7,28	6,92	6,58	6,26	5,96
		Amort. final	Fecha 30/12/2028	01/08/2028	11/03/2028	23/10/2027	14/06/2027	10/02/2027	16/10/2026	29/06/2026
Serie D	Con amortización opcional *	Vida media	Años 4,51	4,25	3,75	3,50	3,25	3,00	2,75	2,50
		Amort. final	Fecha 15/01/2025	15/10/2024	15/04/2024	15/01/2024	15/10/2023	15/10/2023	15/07/2023	15/04/2023
Serie E	Sin amortización opcional *	Vida media	Años 12,99	12,79	12,59	12,36	12,13	11,88	11,63	11,37
		Amort. final	Fecha 06/07/2033	27/04/2033	10/02/2033	20/11/2032	27/08/2032	29/05/2032	26/02/2032	24/11/2031

* 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%.

Información adicional

