

BANCAJA 10 Fondo de Titulización de Activos



Informe resumen

Fecha: 31/01/2014
Divisa: EUR

Fecha constitución
26/01/2007

NIF
V84966126

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

Originador/Cedente Activos
Bancaja

Administrador Activos
Bancaja

Directores Emisión Bonos
Bancaja
Barclays Bank
Calyon
JP Morgan

Aseguradores y Colocadores Bonos
Bancaja
Barclays Bank
Calyon
JP Morgan

Agente Pago Bonos
Barclays Bank PLC

Mercado Negociación
AIAF Mercado de Renta Fija

Registro Contable Bonos
Iberclear

Cuenta Tesorería
Barclays Bank PLC

Préstamo Gastos Iniciales
Bancaja

Depositorio Activos
Bancaja

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

Permuta Intereses
JP Morgan Chase

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 Moody´s / S&P	
		Actual	Inicial			Vencimiento Final (legal) / frecuencia	Próxima	Actual	Inicial
Serie A1 ES0312872007	31/01/2007 4.200	0,00 0,00 0,00%	100.000,00 420.000.000,00	Variable Euribor 3M+0,050% 22.Feb/May/Ago/Nov		22/02/2050 Trimestral 22.Feb/May/Ago/Nov	Amortizada	Aaa AAA	
Serie A2 ES0312872015	31/01/2007 15.370	50.464,96 775.646.435,20 50,46%	100.000,00 1.537.000.000,00	Variable Euribor 3M+0,120% 22.Feb/May/Ago/Nov	0,3390% 24/02/2014 44,669900 Bruto 35,289221 Neto	22/02/2050 Trimestral 22.Feb/May/Ago/Nov	A Determinar "Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	Baa3sf AA-sf AAA	Aaa AAA
Serie A3 ES0312872023	31/01/2007 5.000	97.199,77 485.998.850,00 97,20%	100.000,00 500.000.000,00	Variable Euribor 3M+0,190% 22.Feb/May/Ago/Nov	0,4090% 24/02/2014 103,803954 Bruto 82,005124 Neto	22/02/2050 Trimestral 22.Feb/May/Ago/Nov	A Determinar "Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	Baa3sf AA-sf AAA	Aaa AAA
Serie B ES0312872031	31/01/2007 650	100.000,00 65.000.000,00 100,00%	100.000,00 65.000.000,00	Variable Euribor 3M+0,270% 22.Feb/May/Ago/Nov	0,4890% 24/02/2014 127,683333 Bruto 100,869833 Neto	22/02/2050 Trimestral 22.Feb/May/Ago/Nov	A Determinar "Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	Caa1sf B+sf A	A1 A
Serie C ES0312872049	31/01/2007 520	100.000,00 52.000.000,00 100,00%	100.000,00 52.000.000,00	Variable Euribor 3M+0,500% 22.Feb/May/Ago/Nov	0,7190% 24/02/2014 187,738889 Bruto 148,313722 Neto	22/02/2050 Trimestral 22.Feb/May/Ago/Nov	A Determinar "Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	Casf CCCsf BBB	Baa3 BBB
Serie D ES0312872056	31/01/2007 260	100.000,00 26.000.000,00 100,00%	100.000,00 26.000.000,00	Variable Euribor 3M+1,800% 22.Feb/May/Ago/Nov	2,1190% 24/02/2014 553,284444 Bruto 437,102611 Neto	22/02/2050 Trimestral 22.Feb/May/Ago/Nov	A Determinar "Pass-Through" Secuencial / Prorrata según circunstancias	C Dsf	Ba3 BB
Serie E ES0312872064	31/01/2007 310	100.000,00 31.000.000,00 100,00%	100.000,00 31.000.000,00	Variable Euribor 3M+4,000% 22.Feb/May/Ago/Nov	4,2190% 24/02/2014 1.101,627778 Bruto 870,285945 Neto	22/02/2050 Trimestral 22.Feb/May/Ago/Nov	A Determinar Por reducción Fondo Reserva	C Dsf	Ca CCC-
Total		1.435.645.285,20	2.631.000.000,00						

Vida media y amortización final (en años) estimadas según diferentes hipótesis de % de tasa constante de amortización anticipada o prepago (TACP)													
			% TACP Mensual		0,17	0,34	0,51	0,69	0,87	1,06	1,25	1,44	
			% TACP Anual equivalente		2,00	4,00	6,00	8,00	10,00	12,00	14,00	16,00	
Serie A2	Con amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	4,97	4,00	3,33	2,86	2,50	2,23	2,01	1,83	
		Amort. final	Años	Fecha	08/11/2018	19/11/2017	22/03/2017	29/09/2016	23/05/2016	13/02/2016	25/11/2015	22/09/2015	
	Sin amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	10,26	8,50	7,01	6,00	5,25	4,75	4,25	3,75	
		Amort. final	Años	Fecha	22/02/2024	22/05/2022	22/11/2020	22/11/2019	22/02/2019	22/08/2018	22/02/2018	22/08/2017	
Serie A3	Con amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	4,97	4,00	3,33	2,86	2,50	2,23	2,01	1,83	
		Amort. final	Años	Fecha	08/11/2018	19/11/2017	22/03/2017	29/09/2016	23/05/2016	13/02/2016	25/11/2015	22/09/2015	
	Sin amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	10,26	8,50	7,01	6,00	5,25	4,75	4,25	3,75	
		Amort. final	Años	Fecha	22/02/2024	22/05/2022	22/11/2020	22/11/2019	22/02/2019	22/08/2018	22/02/2018	22/08/2017	
	Con amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	14,45	12,40	10,72	9,32	8,18	7,29	6,53	5,93	
		Amort. final	Años	Fecha	29/04/2028	15/04/2026	07/08/2024	15/03/2023	24/01/2022	06/03/2021	05/06/2020	27/10/2019	
	Sin amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	17,76	15,76	14,01	12,26	10,76	9,75	8,75	8,01	
		Amort. final	Años	Fecha	22/08/2031	22/08/2029	22/11/2027	22/02/2026	22/08/2024	22/08/2023	22/08/2022	22/11/2021	
	Con amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	14,59	12,55	10,84	9,45	8,32	7,40	6,65	6,02	
		Amort. final	Años	Fecha	20/06/2028	06/06/2026	21/09/2024	02/05/2023	16/03/2022	15/04/2021	13/07/2020	27/11/2019	
	Sin amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	19,51	17,76	15,76	14,01	12,50	11,26	10,26	9,26	
		Amort. final	Años	Fecha	22/05/2033	22/08/2031	22/08/2029	22/11/2027	22/05/2026	22/02/2025	22/02/2024	22/02/2023	
Serie B	Con amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	17,76	15,76	14,01	12,26	10,76	9,75	8,75	8,01	
		Amort. final	Años	Fecha	22/08/2031	22/08/2029	22/11/2027	22/02/2026	22/08/2024	22/08/2023	22/08/2022	22/11/2021	
	Sin amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	20,42	18,66	16,84	15,14	13,59	12,23	11,08	10,08	
		Amort. final	Años	Fecha	19/04/2034	17/07/2032	19/09/2030	07/01/2029	22/06/2027	12/02/2026	16/12/2024	18/12/2023	
	Con amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	21,27	19,76	18,01	16,26	14,76	13,26	12,01	11,01	
		Amort. final	Años	Fecha	22/02/2035	22/08/2033	22/11/2031	22/02/2030	22/08/2028	22/02/2027	22/11/2025	22/11/2024	
	Serie C	Con amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	17,76	15,76	14,01	12,26	10,76	9,75	8,75	8,01
			Amort. final	Años	Fecha	22/08/2031	22/08/2029	22/11/2027	22/02/2026	22/08/2024	22/08/2023	22/08/2022	22/11/2021
Sin amortización opcional *		Vida media	Años	Fecha	22,06	20,64	19,05	17,38	15,82	14,38	13,09	11,95	
		Amort. final	Años	Fecha	07/12/2035	06/07/2034	05/12/2032	07/04/2031	12/09/2029	04/04/2028	20/12/2026	31/10/2025	
	Con amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	23,02	21,51	20,27	18,76	17,01	15,76	14,26	13,01	
		Amort. final	Años	Fecha	22/11/2036	22/05/2035	22/02/2034	22/08/2032	22/11/2030	22/08/2029	22/02/2028	22/11/2026	
	Serie D	Con amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	17,76	15,76	14,01	12,26	10,76	9,75	8,75	8,01
			Amort. final	Años	Fecha	21/08/2031	22/08/2029	22/11/2027	22/02/2026	22/08/2024	22/08/2023	22/08/2022	22/11/2021
Sin amortización opcional *		Vida media	Años	Fecha	17,76	15,76	14,01	12,26	10,76	9,75	8,75	8,01	
		Amort. final	Años	Fecha	22/08/2031	22/08/2029	22/11/2027	22/02/2026	22/08/2024	22/08/2023	22/08/2022	22/11/2021	
	Con amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	23,88	22,25	20,92	19,48	17,94	16,48	15,12	13,89	
		Amort. final	Años	Fecha	03/10/2037	17/02/2036	17/10/2034	09/05/2033	27/10/2031	10/05/2030	01/01/2029	08/10/2028	
	Sin amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	24,76	23,02	21,76	20,27	18,76	17,51	16,01	14,76	
		Amort. final	Años	Fecha	22/08/2038	22/11/2036	22/08/2035	22/02/2034	22/08/2032	22/05/2031	22/11/2029	22/08/2028	
Serie E	Con amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	17,76	15,76	14,01	12,26	10,76	9,75	8,75	8,01	
		Amort. final	Años	Fecha	22/08/2031	22/08/2029	22/11/2027	22/02/2026	22/08/2024	22/08/2023	22/08/2022	22/11/2021	
	Sin amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	17,76	15,76	14,01	12,26	10,76	9,75	8,75	8,01	
		Amort. final	Años	Fecha	22/08/2031	22/08/2029	22/11/2027	22/02/2026	22/08/2024	22/08/2023	22/08/2022	22/11/2021	
	Con amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	24,76	23,02	21,76	20,27	18,76	17,51	16,01	14,76	
		Amort. final	Años	Fecha	22/08/2038	22/11/2036	22/08/2035	22/02/2034	22/08/2032	22/05/2031	22/11/2029	22/08/2028	
	Sin amortización opcional *	Vida media	Años	Fecha	24,76	23,02	21,76	20,27	18,76	17,51	16,01	14,76	
		Amort. final	Años	Fecha	22/08/2038	22/11/2036	22/08/2035	22/02/2034	22/08/2032	22/05/2031	22/11/2029	22/08/2028	

Informe resumen

Fecha: 31/01/2014
Divisa: EUR

Fecha constitución
26/01/2007

NIF
V84966126

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

Originador/Cedente Activos
Bancaja

Administrador Activos
Bancaja

Directores Emisión Bonos
Bancaja
Barclays Bank
Calyon
JP Morgan

Aseguradores y Colocadores Bonos
Bancaja
Barclays Bank
Calyon
JP Morgan

Agente Pago Bonos
Barclays Bank PLC

Mercado Negociación
AIAF Mercado de Renta Fija

Registro Contable Bonos
Iberclear

Cuenta Tesorería
Barclays Bank PLC

Préstamo Gastos Iniciales
Bancaja

Depositario Activos
Bancaja

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

Permuta Intereses
JP Morgan Chase

Mejora de crédito y otras operaciones financieras

Mejora crediticia (MC)							
		Actual		A la emisión			