

Notas Explicativas

La cartera inicial de este fondo procedía del Fondo de Titulización EBN WANNAFINANCE I, y fue intención de las partes liquidarlo con el consentimiento de su único titular de los bonos y constituir con carácter simultáneo un nuevo fondo de titulización bajo la denominación de WANNA XXI, FT. Adicionalmente el Cedente cedió los derechos de crédito que recompró de la cartera del fondo de titulización IM WANNA II.

Los derechos de crédito de estos fondos fueron comprados, con diferente nivel de impago y cartera fallida. A final del ejercicio se procederá al deterioro de toda la cartera.

El fondo no mantiene activos disponibles para la venta ni cobertura de flujos de efectivo por tanto, no hay para cumplimentar en el S.04.

La vida media esperada de las obligaciones y valores emitidos, se ha calculado sin tener en cuenta ninguna hipótesis de tasa de amortización, morosidad, recuperaciones, etc..., se calcula teniendo en cuenta la fecha final vigente del Fondo.

Las dos primeras compras han generado una prima de emisión, sobrepago pagado por la compra de los derechos, este importe 40.658 euros ha sido clasificado en la casilla 0040 de Activo No Corriente, Otros Activos No Corrientes