

Notas Explicativas Informes CNMV Trimestral TDA 2015-1

El fondo se encuentra constituido por las siguientes entidades que han sido clasificadas como OTROS.

Entidad: TCA ECDF INVESTMENTS S.A.R.L Código: 153
Entidad: UBI BANCA INTERNATIONAL S.A. Código: 153
Entidad: ABANCA CORPORACIÓN BANCARIA S.A. Código: 153
Entidad: COMMERZBANK AKTIENGESELLSCHAFT, S.E. Código: 153
Entidad: TDA 2017-2, FT Código: 153
Entidad: Global Vía Código: 153
Entidad: Ausur Código: 153
Entidad: Eurogranson Código: 153
Entidad: Pralesa Código: 153
Entidad: JP Morgan Código: 153
Entidad: BAML Código: 153

En el Estado S.05.1 cuadro A, las hipótesis en el escenario inicial referentes a la tasa de activos dudosos, tasa de fallidos y tasa de recuperación de fallidos han sido informadas como cero debido a que el concepto de fallido y activos morosos, que se recogen en el folleto del Fondo, no coincide con la definición de fallido contable y activo dudoso de la Circular 2/2016 de la CNMV, aplicable a las tasas solicitadas en este Estado.

Los importes que figuran en el Estado S.05.2 cuadro E, correspondiente a la vida residual contractual esperada de las obligaciones y otros valores emitidos, se han calculado sin considerar el efecto de hipótesis tales como tasa de amortización anticipada, morosidad, recuperaciones, etc. No obstante, la amortización de estos pasivos financieros dependen de la liquidez que generará el Fondo, la cual está condicionada al comportamiento de la cartera sobre morosidad, recuperaciones, amortizaciones anticipadas, etc, por lo que, en el caso de que se generara una liquidez diferente, las estimaciones previstas podrían verse modificadas.