

Notas Explicativas

- El fondo no mantiene activos disponibles para la venta, 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.
- S.06 [1660] – Notas Explicativas

Con respecto al estado S.02 [1620] – “Cuenta de Pérdidas y Ganancias” se informa de lo siguiente:

En la celda 0202 de ingresos por: “1. Intereses y rendimiento asimilado”, apartado 1.1 de “Activos titulizados”, los importes declarados hasta este trimestre han tenido un error en su valoración y que se procede a su rectificación.

El importe a corregir es de 252 mil euros, al no poder presentar en la celda 0202 un importe negativo y mantener esta corrección dentro de “MARGEN DE INTERESES” se procede a grabar este importe corrector dentro de la Elda 0207 de “Otros pasivos financieros”

