

## Notas Explicativas

- 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.
  
- S.06 [1660] – Notas Explicativas
  - La casilla 0157 de 72 mil se compone de:
    - AEAT 7 mil
    - Auditores: 5 mil
    - Partidas en tránsito, cobros por diferencia de fecha valor: 60 mil
  - Casilla 0207 por 31 mil, se compone de:
    - Pérdida por fallidos derechos crédito