

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: DEUTSCHE BANK AG LONDON BRANCH Código: 153

Entidad: BANKINTER Código: 41

Entidad: BARCLAYS BANK, SA Código: 45

Entidad: GRUPO BANCO SABADELL Código: 24

Entidad: IBERCAJA Código: 81

Entidad: CAJAMAR Código: 92

En el Estado S.05.1 cuadro D, 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 2/2009 de la CNMV, aplicable a las tasas solicitadas en este Estado.