En la contabilidad del Fondo no se ha dado de baja del activo ningún Derecho de Crédito por fallido, sin perjuicio de la la correspondiente corrección de su valor por deterioro según la Norma 13ª de la Circular 2/2016.
Tabla S.05_1D: Las hipótesis de morosidad, tasa de fallidos y recuperación de fallidos en el escenario inicial son las consideradas para la estimación de flujos de los bonos recogidas en el folleto de emisión. La cartera cedida en el momento inicial no tenía impago superior a 90 días.
Tabla S.05_2 cuadro A campo [0004],Hipotesis Utilizadas para el cálculo de la Vida Media de los Bonos:

HIPO. CENTRAL - CPR: 5,350 ,CALL: 0 ,Fallidos: 0,366 ,Recu. Fallidos: 75 ,Impago: 0,407
Tabla S.05_2 cuadro B campo [9980], tipo de interés aplicado en la ultima fecha de determinación.
Tabla S.05_5 cuadro C Distribución según el porcentaje del importe pendiente de amortizar de los préstamos sobre el el valor de tasación de los inmuebles del que dispone la gestora. Solo se consideran préstamos con garantía hipotecaria.
Tabla S.05_5 cuadro D Principales índices de referencia:
EUR12: Rate published by the European Banking Federation for 1-year Euro deposit transactions.
MIB12: Madrid Interbank Offered Rate for 1-year deposit transactions.
EURH: Monthly EUR12 average published by the Bank of Spain, paragraph 19,1 of the statistical bulletin,Mortgage Market Market Official Reference Rates.
MIBH: Monthly MIB12 average published by the Bank of Spain, paragraph 19,1 of the statistical bulletin, Mortgage Market Official Reference Rates.
IRPHCE: Monthly average rate for mortgage loans over 3 years to purchase free housing from Banks, Cajas de Ahorros and Mortgage Lending Companies, published by the Bank of Spain, paragraph 19,1 of the statistical bulletin, Mortgage Market Official Reference Rates.
IRPHB: Monthly average rate for mortgage loans over 3 years to purchase free housing from Banks, published by the Bank Bank of Spain, paragraph 19,1 of the statistical bulletin, Mortgage Market Official Reference Rates.
IRPHC: Monthly average rate for mortgage loans over 3 years to purchase free housing from Cajas de Ahorros, published by by the Bank of Spain, paragraph 19,1 of the statistical bulletin, Mortgage Market Official Reference Rates.