Notas Explicativas Informes CNMV Trimestral FADE

El fondo se encuentra constituido por las siguientes entidades que han sido clasificadas como OTROS.
Entidad: E.ON ESPAÑA Codigo: 153
Entidad: E.ON GENERACIÓN Codigo: 153
Entidad: GAS NATURAL SDG Codigo: 153
Entidad: UNIÓN ELÉCTRICA DE CANARIAS GENERACIÓN Codigo: 153
Entidad: ELCOGÁS Codigo: 153
Entidad: GAS Y ELECTRICIDAD GENERACION Codigo: 153
Entidad: ENDESA GENERACIÓN Codigo: 153
Entidad: HIDROELÉCTRICA DEL CANTÁBRICO Codigo: 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.