

GAT ICO-FTVPO 1 FTH

(N.I.F.V65102576)

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption

FECHA DE PAGO / Payment date

22.03.2021

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

21.12.2020 (incluido) / (included)
22.03.2021 (excluido) / (excluded)
91 días / days

Bonos Serie AG	Bonos Serie B (CA)	Bonos Serie B (CM)	Bonos Serie B (CP)	Bonos Serie B (CT)
Series AG Bonds	Series B (CA) Bonds	Series B (CM) Bonds	Series B (CP) Bonds	Series B (CT) Bonds
ES0341068007	ES0341068015	ES0341068023	ES0341068031	ES0341068049

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor
Margen / Margin

17.12.2020

-0,541% -0,541% -0,541% -0,541% -0,541%
0,500% 0,800% 0,800% 0,800% 0,800%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,041% 0,259% 0,259% 0,259% 0,259%

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable interest rate

0,000%* 0,259% 0,259% 0,259% 0,259%

Número de Bonos / N. Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	3.316		98		33		27		20
8.137,72	26.984.679,52	100.000,00	9.800.000,00	100.000,00	3.300.000,00	100.000,00	2.700.000,00	100.000,00	2.000.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax
Intereses Netos / Net Interest

19,00%

0,000000 0,00 65,469444 6.416,01 65,469444 2.160,49 65,469444 1.767,67 65,469444 1.309,39
0,000000 0,00 12,439194 1.219,04 12,439194 410,49 12,439194 335,86 12,439194 248,78
0,000000 0,00 53,030250 5.196,97 53,030250 1.750,00 53,030250 1.431,81 53,030250 1.060,61

Amortización de Principal
Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined A determinar / To be determined A determinar / To be determined A determinar / To be determined A determinar / To be determined

* El Tipo de Interés Nominal aplicable se ha fijado en el 0,000% debido a que los términos del Folleto y en concreto los apartados 4.8 de la Nota de Valores y 3.4.6. del Módulo Adicional a la Nota de Valores no contemplan la posibilidad de un Tipo de Interés Nominal negativo que pudiera dar lugar a intereses a satisfacer por los tenedores de los Bonos a favor del Fondo.

* The applicable Nominal Interest Rate has been set at 0.000% because the terms of the Prospectus and specifically sections 4.8 of the Securities Note and 3.4.6. of the Securities Note Building Block do not provide for the possibility of a negative Nominal Interest Rate which might result in interest being payable by Bondholders to the Fund.

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption

FECHA DE PAGO / Payment date **22.03.2021**

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From **21.12.2020** (incluido) / (included)
hasta / To **22.03.2021** (excluido) / (excluded)
plazo / Term **91** días / days

Bonos Serie C (CA)	Bonos Serie C (CM)	Bonos Serie C (CP)	Bonos Serie C (CT)
Series C (CA) Bonds	Series C (CM) Bonds	Series C (CP) Bonds	Series C (CT) Bonds
ES0341068056	ES0341068064	ES0341068072	ES0341068080

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor 17.12.2020 -0,541% -0,541% -0,541% -0,541%
Margen / Margin 2,000% 2,000% 2,000% 2,000%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate 1,459% 1,459% 1,459% 1,459%

Tipo de Interés Nominal aplicable

Applicable interest rate

1,459% **1,459%** **1,459%** **1,459%**

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value

(Euros) **100.000,00** **3.200.000,00** **100.000,00** **2.300.000,00** **100.000,00** **1.500.000,00** **100.000,00** **1.500.000,00**

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros) **Base / Day count fraction** Act / **360**

Intereses Brutos / Gross Interest **368,802778** 11.801,69 **368,802778** 8.482,46 **368,802778** 5.532,04 **368,802778** 5.532,04
Retención / Withholding tax **19,00%** **70,072528** 2.242,32 **70,072528** 1.611,67 **70,072528** 1.051,09 **70,072528** 1.051,09
Intereses Netos / Net Interest **298,730250** 9.559,37 **298,730250** 6.870,79 **298,730250** 4.480,95 **298,730250** 4.480,95

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros) **Amortización / Redemption** **A determinar / To be determined** **A determinar / To be determined** **A determinar / To be determined** **A determinar / To be determined**

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption

FECHA DE PAGO / Payment date

22.03.2021

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From 21.12.2020 (incluido) / (included)
hasta / To 22.03.2021 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie D (CA)	Bonos Serie D (CM)	Bonos Serie D (CP)	Bonos Serie D (CT)
Series D (CA) Bonds	Series D (CM) Bonds	Series D (CP) Bonds	Series D (CT) Bonds
ES0341068098	ES0341068106	ES0341068114	ES0341068122

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor	17.12.2020	-0,541%	-0,541%	-0,541%	-0,541%
Margen / Margin		5,000%	5,000%	5,000%	5,000%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

4,459% 4,459% 4,459% 4,459%

Tipo de Interés Nominal aplicable

Applicable interest rate

4,459% **4,459%** **4,459%** **4,459%**

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	61		25		16		14

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction	Act /	360							
Intereses Brutos / Gross Interest		585,391665	35.708,89	979,779859	24.494,50	633,456243	10.135,30	821,850845	11.505,91
Retención / Withholding tax	19,00%	111,224416	6.784,69	186,158173	4.653,95	120,356686	1.925,71	156,151661	2.186,12
Intereses Netos / Net Interest		474,167249	28.924,20	793,621686	19.840,55	513,099557	8.209,59	665,699184	9.319,79

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined A determinar / To be determined A determinar / To be determined A determinar / To be determined

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha vencimiento / Maturity date	22.06.2020 / 21.12.2020	20.06.2019 / 21.12.2020	20.12.2018 / 21.12.2020	20.03.2020 / 21.12.2020
Intereses Brutos / Gross Interest	1.818,716278	110.941,69	6.261,477525	156.536,94
Retención / Withholding tax	19,00%	345,556092	21.078,92	1.189,680730
Intereses Netos / Net Interest	1.473,160186	89.862,77	5.071,796795	126.794,93