

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
25.03.2021
Período de Interés / Interest accrual period

 desde / From **28.12.2020** (incluido) / (included)
 hasta / To **25.03.2021** (excluido) / (excluded)
 plazo / Term **87** días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0312888011	ES0312888029	ES0312888037	ES0312888045	ES0312888052

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation
Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

23.12.2020

-0,541%

-0,541%

-0,541%

-0,541%

-0,541%

Margen / Margin

0,130%

0,280%

0,560%

2,500%

4,000%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,411%

-0,261%

0,019%

1,959%

3,459%

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable Interest Rate

0,000%*

0,000%*

0,019%

1,959%

3,459%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	17.000		520		250		230		226	
Número de Bonos / N.Bonds										
Nominal / Face value	(Euros) 15.382,31	261.499.270,00	100.000,00	52.000.000,00	100.000,00	25.000.000,00	100.000,00	23.000.000,00	100.000,00	22.600.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

4,591667

1.147,92

473,425000

108.887,75

835,925000

188.919,05

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,872417

218,10

89,950750

20.688,67

158,825750

35.894,62

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

3,719250

929,82

383,474250

88.199,08

677,099250

153.024,43

Amortización de Principal
Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Intereses Impagados Periodos Anteriores
Payments outstanding due to insufficient Available Funds

(Euros)

Unpaid Interest from previous periods
Fecha de vencimiento / Maturity date
Intereses Brutos / Gross Interest

25.06.2008 / 28.12.2020

Retención / Withholding tax

19,00%

Intereses Netos / Net Interest

58.851,555457

13.300.451,53

11.181,795537

2.527.085,80

47.669,759920

10.773.365,73

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Intereses por Aplazamiento de Intereses Impagados
Payments outstanding due to insufficient Available Funds

(Euros)

Interest Payment of deferred unpaid interest
Fecha de vencimiento / Maturity date
Intereses Brutos / Gross Interest

25.06.2008 / 28.12.2020

Retención / Withholding tax

19,00%

Intereses Netos / Net Interest

16.949,511549

3.830.589,61

3.220,407194

727.812,03

13.729,104355

3.102.777,58

* 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 3.4.6.2.1 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 3.4.6.2.1 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.