

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

23.11.2020

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From **24.08.2020** (incluido) / (included)
hasta / To **23.11.2020** (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series A3 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0312872015	ES0312872023	ES0312872031	ES0312872049	ES0312872056	ES0312872064

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 20/08/2020 -0,491%
Margen / Margin 0,120%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,371%

-0,491%	-0,491%	-0,491%	-0,491%	-0,491%	-0,491%
0,120%	0,190%	0,270%	0,500%	1,900%	4,000%
-0,371%	-0,301%	-0,221%	0,009%	1,409%	3,509%

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable interest rate

0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,009%	1,409%	3,509%
---------	---------	---------	--------	--------	--------

Número de Bonos / N. Bonds
Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
10.272,89	15.370	97.199,77	485.998.850,00	100.000,00	650	100.000,00	520	100.000,00	260	100.000,00	310
157.894.319,30	5.000	485.998.850,00	650	520	260	310					

Liquidación de Intereses
Interest Payment (Euros)

Base / Day count fraction Act / 360
Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax 19,00%
Intereses Netos / Net Interest

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	2,275000	1.183,00	356,163889	92.602,61	886,997222	274.969,14
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,432250	224,77	67,671139	17.594,50	168,529472	52.244,14
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	1,842750	958,23	288,492750	75.008,11	718,467750	222.725,00

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros)

A determinar / To be determined 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments outstanding due to insufficient Available Funds (Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date
Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax 19,00%
Intereses Netos / Net Interest

		24.02.2014 / 24.08.2020	22.08.2013 / 24.08.2020	24.11.2008 / 24.08.2020
2.205,783333	1.147.007,34	12.879,138888	3.348.576,12	53.041.585215
419,098833	217.931,40	2.447,036388	636.229,45	10.077,901188
1.786,684500	929.075,94	10.432,102500	2.712.346,67	42.963,684027
				16.442.891,38
				3.124.149,35
				13.318.742,03

* 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.