

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS
Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Amortisation
FECHA DE PAGO / Payment date
25.11.2020
Periodo de Interés / Interest accrual period

 desde / From **25.08.2020** (incluido) / (included)
 hasta / To **25.11.2020** (excluido) / (excluded)
 plazo / Term **92** días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E	Bonos Serie F
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds	Series F Bonds
ES0361795000	ES0361795018	ES0361795026	ES0361795034	ES0361795042	ES0361795059

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Calculation
Euribor 3 meses / 3 Month Euribor
Margen / Margin
Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate
Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

21/08/2020	-0,487%	-0,487%	-0,487%	-0,487%	-0,487%	-0,487%
	0,150%	0,240%	0,340%	0,500%	1,850%	4,000%
	-0,337%	-0,247%	-0,147%	0,013%	1,363%	3,513%
	0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,013%	1,363%	3,513%

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	7.544		132		104		88		132		92	
(Euros)	7.067,35	53.316.088,40	21.216,15	2.800.531,80	21.216,15	2.206.479,60	29.619,49	2.606.515,12	100.000,00	13.200.000,00	54.347,83	5.000.000,36

Liquidación de Intereses
Interest Payment
Base / Day count fraction
Act / 360
Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax
Intereses Netos / Net Interest

(Euros)	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,984025	86,59	348,322222	45.978,53	487,916702	44.888,34
19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,186965	16,45	66,181222	8.735,92	92,704173	8.528,78
	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,797060	70,14	282,141000	37.242,61	395,212529	36.359,56

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	0,00	0,00	0,00
------	------	------	------	------	------	------	------	------	------	------	------	------

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments not made due to insufficient Available Funds
(Euros)
Fecha vencimiento / Maturity date
Amortización de Principal / Principal Redemption
Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax
Intereses Netos / Net Interest
19,00%
25.11.2019 / 25.08.2020

1.994,462704	183.490,56
378,947914	34.863,22
1.615,514790	148.627,34

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles Intereses por Aplazamiento de Intereses Impagados
Payments outstanding due to insufficient Available Funds Interest Payment of deferred unpaid interest
(Euros)
Fecha de Vencimiento / Maturity Date
Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax
Intereses Netos / Net Interest
19%
25.02.2020/ 25.08.2020

27,442826	2.524,74
5,214137	479,70
22,228689	2.045,04

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 II.10 y V.4.2.1 del Folleto Informativo 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 II.10 and V.4.2.1 of the Prospectus do not provide for the possibility of a negative Nominal Interest Rate which might result in interest being payable by Bondholders to the Fund