

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

19.10.2020

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 20.07.2020 (incluido) / (included)
hasta / To 19.10.2020 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie A2a	Bonos Serie A2b	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2a Bonds	Series A2b Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0366367011	ES0366367029	ES0366367037	ES0366367045	ES0366367052	ES0366367060

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor 16/07/2020 -0,449%
Margen / Margin 0,130%
Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate -0,319%
Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate 0,000%*

-0,449%	-0,449%	-0,449%	-0,449%	-0,449%	-0,449%
0,130%	0,140%	0,250%	0,550%	2,000%	4,000%
-0,319%	-0,309%	-0,199%	0,101%	1,551%	3,551%
0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,101%	1,551%	3,551%

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
	8.024		3.500		273		156		72		234
16.159,49	129.663.747,76	16.159,49	56.558.215,00	33.008,09	9.011.208,57	34.158,60	5.328.741,60	100.000,00	7.200.000,00	25.000,00	5.850.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment (Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest 0,000000
Retención / Withholding tax 19,00%
Intereses Netos / Net Interest 0,000000

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	8,720880	1.360,46	392,058333	28.228,20	224,403472	52.510,41
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	1,656967	258,49	74,491083	5.363,36	42,636660	9.976,98
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	7,063913	1.101,97	317,567250	22.864,84	181,766812	42.533,43

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros)

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

* 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.