

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
19.04.2021
Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / Fr 19.01.2021 (incluido) / (included)
hasta / To 19.04.2021 (excluido) / (excluded)
plazo / Te 90 días / days

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

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

15/01/2021

-0,552%

-0,552%

-0,552%

-0,552%

-0,552%

-0,552%

Margen / Margin

0,130%

0,140%

0,250%

0,550%

2,000%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate

-0,422%

-0,412%

-0,302%

-0,002%

1,448%

3,448%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

0,000%

0,000%

0,000%

0,000%

1,448%

3,448%

Número de Bonos / N. Bonds

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
	8.024		3.500		273		156		72		234

Nominal / Face value

(Euros)

14.814,45 118.871.146,80 14.814,45 51.850.575,00 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

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

362,000000

26.064,00

215,500000

50.427,00

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

68,780000

4.952,16

40,945000

9.581,13

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

293,220000

21.111,84

174,555000

40.845,87

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

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments not made due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date

19.01.2021

Intereses Brutos / Gross Interest

223,163889

52.220,35

Retención / Withholding tax

19,00%

42,401139

9.921,87

Neto / Net Interest

180,762750

42.298,48

* 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.