

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

25.01.2021

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

26.10.2020 (incluido) / (included)
25.01.2021 (excluido) / (excluded)
91 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0312887005	ES0312887013	ES0312887021	ES0312887039	ES0312887047

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	22.10.2020	-0,511%	-0,511%	-0,511%	-0,511%	-0,511%
Margen / Margin		0,110%	0,230%	0,450%	1,750%	3,500%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,401%	-0,281%	-0,061%	1,239%	2,989%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

	0,000%*	0,000%*	0,000%*	1,239%	2,989%
--	----------------	----------------	----------------	---------------	---------------

Número de Bonos / N. Bonds
Nominal / Face value

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	15.617	602	149	132	301					
(Euros)	9.491,46	148.228.130,82	100.000,00	60.200.000,00	100.000,00	14.900.000,00	100.000,00	13.200.000,00	93.355,49	28.100.002,49

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	313,191667	41.341,30	705,349998	212.310,35
Retención / Withholding tax	19%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	59,506417	7.854,85	134,016500	40.338,97
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	253,685250	33.486,45	571,333498	171.971,38

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
---------------------------	---------	--------------	------------------	------	------	------	------	------	------	------	------

* 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.