

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 26.03.2021

Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From 28.12.2020 (incluido) / (included)
hasta / To 26.03.2021 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 88 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0313547004	ES0313547012	ES0313547020

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	23.12.2020	-0,541%	-0,541%	-0,541%
Margen / Margin		0,210%	0,550%	1,200%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,331%	0,009%	0,659%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,009%	0,659%

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	4.718		130		52
9.347,53	44.101.646,54	24.245,23	3.151.879,90	24.016,50	1.248.858,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction	Act /	360				
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,533395	69,34	38,687913
Retención / Withholding tax	19,0%	0,000000	0,00	0,101345	13,17	7,350703
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,432050	56,17	31,337210

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar
	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined

* 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 cont 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 pc Nominal Interest Rate which might result in interest being payable by Bondholders to the Fund.