

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

26.06.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

26.03.2020 (incluido) / (included)
26.06.2020 (excluido) / (excluded)
92 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0361796016	ES0361796024	ES0361796032	ES0361796040	ES0361796057

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

24/03/2020

-0,373%

-0,373%

-0,373%

-0,373%

-0,373%

Margen / Margin

0,150%

0,190%

0,290%

0,500%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated Interest Rate

-0,223%

-0,183%

-0,083%

0,127%

3,627%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

0,000%*

0,000%*

0,000%*

0,127%

3,627%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie		
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series		
	6.680		132		116		72		100		
Número de Bonos / N. Bonds											
Nominal / Face value	(Euros)	16.876,87	112.737.491,60	33.385,02	4.406.822,64	34.589,59	4.012.392,44	100.000,00	7.200.000,00	100.000,00	10.000.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

(Euros)

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

32,455556

2.336,80

926,900000

92.690,00

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

6,166556

443,99

176,111000

17.611,10

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

26,289000

1.892,81

750,789000

75.078,90

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To be determined

A determinar / To be determined

A determinar / To be determined

A determinar / To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00

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

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

27.12.2018 - 26.03.2020

5.063,196500

506.319,65

962,007335

96.200,73

4.101,189165

410.118,92

* 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.