

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
24.05.2021
Periodo de Interés / Interest accrual period

 desde / From
 hasta / To
 plazo / Term

22.02.2021 (incluido) / (included)
24.05.2021 (excluido) / (excluded)
 91 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series A3 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0312872015	ES0312872023	ES0312872031	ES0312872049	ES0312872056	ES0312872064

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

18/02/2021

-0,543%

-0,543%

-0,543%

-0,543%

-0,543%

-0,543%

Margen / Margin

0,120%

0,190%

0,270%

0,500%

1,900%

4,000%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,423%

-0,353%

-0,273%

-0,043%

1,357%

3,457%

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable interest rate

0,000%*

0,000%*

0,000%*

0,000%*

1,357%

3,457%

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
	15.370		5.000		650		520		260		310
4.254,66	65.394.124,20	97.199,77	485.998.850,00	100.000,00	65.000.000,00	100.000,00	52.000.000,00	100.000,00	26.000.000,00	100.000,00	31.000.000,00

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

343,019444

89.185,06

873,852778

270.894,36

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

65,173694

16.945,16

166,032028

51.469,93

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

277,845750

72.239,90

707,820750

219.424,43

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

0,00

0,00

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments outstanding due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date
Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax

19,00%

Intereses Netos / Net Interest

24.02.2014 / 22.02.2021		22.08.2013 / 22.02.2021		24.11.2008 / 22.02.2021	
2.208,058333	1.148.190,34	13.582,366666	3.531.415,34	54.806,479659	16.990.008,66
419,531083	218.156,17	2.580,649666	670.968,91	10.413,231132	3.228.101,64
1.788,527250	930.034,17	11.001,717000	2.860.446,43	44.393,248527	13.761.907,02

* 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.