

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

28.09.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

26.06.2020 (incluido) / (included)
28.09.2020 (excluido) / (excluded)
94 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

24/06/2020

-0,398%

-0,398%

-0,398%

-0,398%

-0,398%

Margen / Margin

0,150%

0,190%

0,290%

0,500%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated Interest Rate

-0,248%

-0,208%

-0,108%

0,102%

3,602%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

0,000%*

0,000%*

0,000%*

0,102%

3,602%

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) 16.287,16	108.798.228,80	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

26,633333

1.917,60

940,522222

94.052,22

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

5,060333

364,34

178,699222

17.869,92

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

21,573000

1.553,26

761,823000

76.182,30

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 - 26.06.2020

5.990,096500

599.009,65

1.138,118335

113.811,83

4.851,978165

485.197,82

* 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.