

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
22.02.2021
Periodo de Interés / Interest accrual period

 desde / From
 hasta / To
 plazo / Term

23.11.2020 (incluido) / (included)
22.02.2021 (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	19/11/2020	-0,527%	-0,527%	-0,527%	-0,527%	-0,527%	-0,527%
Margen / Margin		0,120%	0,190%	0,270%	0,500%	1,900%	4,000%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,407%	-0,337%	-0,257%	-0,027%	1,373%	3,473%

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable interest rate

0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,000%*	1,373%	3,473%
----------------	----------------	----------------	----------------	---------------	---------------

Número de Bonos / N.Bonds		15.370	5.000	650	520	260	310						
Nominal / Face value	(Euros)	7.356,48	113.069.097,60	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	347,063889	90.236,61	877,897222	272.148,14
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	65,942139	17.144,96	166,800472	51.708,15
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	281,121750	73.091,65	711,096750	220.439,99

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		24.02.2014 / 23.11.2020		22.08.2013 / 23.11.2020		24.11.2008 / 23.11.2020	
Intereses Brutos / Gross Interest		2.208,058333	1.148.190,34	13.235,302777	3.441.178,73	53.928,582437	16.717.860,52
Retención / Withholding tax	19,00%	419,531083	218.156,17	2.514,707527	653.823,95	10.246,430660	3.176.393,49
Intereses Netos / Net Interest		1.788,527250	930.034,17	10.720,595250	2.787.354,78	43.682,151777	13.541.467,03

* 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.