

**DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS**  
Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Amortisation

FECHA DE PAGO / Payment date

19.01.2021

Periodo de Interés /  
Interest accrual period

desde / From 19.10.2020 (incluido) / (included)  
hasta / To 19.01.2021 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A2a	Bonos Serie A2b	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2a Bonds	Series A2b Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0366367011	ES0366367029	ES0366367037	ES0366367045	ES0366367052	ES0366367060

**Determinación Tipo Interés Nominal**  
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor 15/10/2020 -0,507%  
Margen / Margin 0,130%  
Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate -0,377%  
Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate 0,000%\*

-0,507%	-0,507%	-0,507%	-0,507%	-0,507%	-0,507%
0,140%	0,140%	0,250%	0,550%	2,000%	4,000%
-0,367%	-0,257%	0,043%	1,493%	3,493%	3,493%
0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,043%	1,493%	3,493%

Número de Bonos / N.Bonds  
Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
8.024	3.500	273	156	72	234						
15.509,62	124.449.190,88	15.509,62	54.283.670,00	33.008,09	9.011.208,57	34.158,60	5.328.741,60	100.000,00	7.200.000,00	25.000,00	5.850.000,00

**Liquidación de Intereses**  
Interest Payment (Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest 0,000000  
Retención / Withholding tax 19,00%  
Intereses Netos / Net Interest 0,000000

0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,753651	585,57	381,544444	27.471,20	223,163889	52.220,35
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,713194	111,26	72,493444	5.219,53	42,401139	9.921,87
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	3,040457	474,31	309,051000	22.251,67	180,762750	42.298,48

**Amortización de Principal**  
Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros)

A determinar / To be determined	A determinar / To be determined	A determinar / To be determined	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
---------------------------------	---------------------------------	---------------------------------	------	------	------	------	------	------	------	------	------

\* 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.