

**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

25.02.2021

Periodo de Interés /  
Interest accrual period

desde / From  
hasta / To  
plazo / Term

25.11.2020 (incluido) / (included)  
25.02.2021 (excluido) / (excluded)  
92 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds
ES0312886015	ES0312886023	ES0312886031	ES0312886049

Determinación Interés Nominal  
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 23.11.2020  
Margen / Margin

-0,523% -0,523% -0,523% -0,523%

Tipo de interés calculado  
Calculated interest rate

0,180% 0,390% 0,780% 2,500%

Tipo de Interés Nominal aplicable  
Applicable interest rate

0,000%\* 0,000%\* 0,257% 1,977%

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

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
10.408,72	16.702	22.057,36	399	22.055,04	238	22.060,78	161
173.846.441,44		8.800.886,64		5.249.099,52		3.551.785,58	

Liquidación de Intereses  
Interest Payment (Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

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

0,000000 0,00 0,000000 0,00 14,485260 3.447,49 111,458414 17.944,80  
0,000000 0,00 0,000000 0,00 2,752199 655,02 21,177099 3.409,51  
0,000000 0,00 0,000000 0,00 11,733061 2.792,47 90,281315 14.535,29

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

\* 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 II.10 y V.4.2.1 del Folleto Informativo 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 II.10 and V.4.2.1 of the Prospectus do not provide for the possibility of a negative Nominal Interest Rate which might result in interest being payable by Bondholders to the Fund.