

**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

15.01.2021

Periodo de interés /  
Interest accrual period

desde / From  
hasta / To  
plazo / Term

15.10.2020  
15.01.2021  
92

(incluido) / (included)  
(excluido) / (excluded)  
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
ES0345721015	ES0345721023	ES0345721031	ES0345721049	ES0345721056	ES0345721064

**Determinación Interés Nominal**  
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor  
Margen / Margin  
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate  
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate

13.10.2020

-0,508%	-0,508%	-0,508%	-0,508%	-0,508%	-0,508%
0,130%	0,130%	0,170%	0,290%	0,530%	4,500%
-0,378%	-0,378%	-0,338%	-0,218%	0,022%	3,992%
0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,022%	3,992%

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
	5,000		2,362		220		183		235		160
12.340,05	61.700.250,00	12.340,05	29.147.198,10	100.000,00	22.000.000,00	100.000,00	18.300.000,00	100.000,00	23.500.000,00	100.000,00	16.000.000,00

**Liquidación de Intereses**  
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest  
Retención / Withholding tax  
Intereses Netos / Net Interest

19,00%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	5,622222	1.321,22	1.020,177778	163.228,44
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	1,068222	251,03	193,833778	31.013,40
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	4,554000	1.070,19	826,344000	132.215,04

**Amortización de Principal**  
Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

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	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

(Euros)

19,00%

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles  
Intereses por Aplazamiento de Intereses Impagados  
Payments outstanding due to insufficient Available Funds  
Interest Payment of deferred unpaid interest

Fecha de Vencimiento / Maturity Date

Intereses Brutos / Gross Interest  
Retención / Withholding tax  
Intereses Netos / Net Interest

(Euros)

19,00%

15.01.2009-15.10.2020

59.391,192221 9.502.590,74  
11.284,326521 1.805.492,23  
48.106,865700 7.697.098,51

15.01.2009-15.10.2020

17.253,775688 2.760.604,11  
3.278,217381 524.514,78  
13.975,558307 2.236.089,33

\* 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 3.4.6.1 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 3.4.6.1 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.