

**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**
**28.12.2020**
**Período de Interés / Interest accrual period**

 desde / From **25.09.2020** (incluido) / (included)  
 hasta / To **28.12.2020** (excluido) / (excluded)  
 plazo / Term **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
ES0312888011	ES0312888029	ES0312888037	ES0312888045	ES0312888052

**Determinación Tipo Interés Nominal**
*Nominal Interest Rate Calculation*
**Euribor 3 meses / 3 Months Euribor**

23.09.2020

**Margen / Margin**
**Tipo de interés calculado / Calculated interest rate**

-0,498%	-0,498%	-0,498%	-0,498%	-0,498%
0,130%	0,280%	0,560%	2,500%	4,000%
-0,368%	-0,218%	0,062%	2,002%	3,502%

**Tipo de Interés Nominal aplicable**
*Applicable Interest Rate*

0,000%*	0,000%*	0,062%	2,002%	3,502%
---------	---------	--------	--------	--------

**Número de Bonos / N. Bonds**
*Nominal / Face value*

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
	17.000		520		250		230		226
16.194,62	275.308.540,00	100.000,00	52.000.000,00	100.000,00	25.000.000,00	100.000,00	23.000.000,00	100.000,00	22.600.000,00

**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	16,188889	4.047,22	522,744444	120.231,22	914,411111	206.656,91
	0,000000	0,00	0,000000	0,00	3,075889	768,97	99,321444	22.843,93	173,738111	39.264,81
	0,000000	0,00	0,000000	0,00	13,113000	3.278,25	423,423000	97.387,29	740,673000	167.392,10

**Amortización de Principal**
*Principal Redemption*

(Euros)

**Amortización / Redemption**
**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**
**Intereses Impagados Periodos Anteriores**
*Payments outstanding due to insufficient Available Funds*

(Euros)

**Fecha de vencimiento / Maturity date**
**Intereses Brutos / Gross Interest**
**Retención / Withholding tax**
**Intereses Netos / Net Interest**

19,00%

**25.06.2008 / 25.09.2020**

57.937,144346	13.093.794,62
11.008,057426	2.487.820,99
46.929,086920	10.605.973,63

**Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles**
**Intereses por Aplazamiento de Intereses Impagados**
*Payments outstanding due to insufficient Available Funds*

(Euros)

**Fecha de vencimiento / Maturity date**
**Intereses Brutos / Gross Interest**
**Retención / Withholding tax**
**Intereses Netos / Net Interest**

19,00%

**25.06.2008 / 25.09.2020**

16.419,727876	3.710.858,50
3.119,748296	705.063,11
13.299,979580	3.005.795,39

\* 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.