

### 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

26.02.2020

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 26.11.2019 (incluido) / (included)  
hasta / To 26.02.2020 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0313546006	ES0313546014	ES0313546022

#### Determinación Interés Nominal

*Nominal Interest Calculation*

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	22.11.2019	-0,403%	-0,403%	-0,403%
Margen / Margin		0,230%	0,600%	1,350%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,173%	0,197%	0,947%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,197%	0,947%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	
	12.953		277		270	
Número de Bonos / N.Bonds						
Nominal / Face value	(Euros) 11.309,12	146.487.031,36	23.593,25	6.535.330,25	23.614,57	6.375.933,90

#### Liquidación de Intereses

*Interest Payment*

Base / Day count fraction	Act /	360					
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	11,877891	3.290,18	57,149883	15.430,47
Retención / Withholding tax	19%	0,000000	0,00	2,256799	625,13	10,858478	2.931,79
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	9,621092	2.665,05	46,291405	12.498,68

#### Amortización de Principal

*Principal Redemption*

Amortización / Redemption	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar
	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	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 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 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.