

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 26.03.2020

Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From 27.12.2019 (incluido) / (included)
hasta / To 26.03.2020 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 90 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0313547004	ES0313547012	ES0313547020

Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	23.12.2019	-0,399%	-0,399%	-0,399%
Margen / Margin		0,210%	0,550%	1,200%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,189%	0,151%	0,801%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,151%	0,801%

Número de Bonos / N. Bonds Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	4.718		130		52
11.672,04	55.068.684,72	24.245,23	3.151.879,90	24.016,50	1.248.858,00

Liquidación de Intereses Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction	Act /	360				
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	9,152574	1.189,83	48,093041
Retención / Withholding tax	19,0%	0,000000	0,00	1,738989	226,07	9,137678
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	7,413585	963,76	38,955363
						2.025,68

Amortización de Principal Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption	A determinar To be determined	A determinar To be determined	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 cont 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 pc Nominal Interest Rate which might result in interest being payable by Bondholders to the Fund.