

**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** 15.09.2020

**Periodo de Interés / Interest accrual period**  
desde / From 15.06.2020 (incluido) / (included)  
hasta / To 15.09.2020 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Serías A Bonds</i>	<i>Serías B Bonds</i>	<i>Serías C Bonds</i>
ES0313548002	ES0313548010	ES0313548028

**Determinación Interés Nominal**  
*Nominal Interest Calculation*

**Euribor 3 meses / 3 Month Euribor** 11/06/2020 -0,358% -0,358% -0,358%

**Margen / Margin** 0,170% 0,480% 1,000%

**Tipo de interés calculado / Calculated interest rate** -0,188% 0,122% 0,642%

**Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate** **0,000%\*** **0,122%** **0,642%**

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	
	10.293		214		193	
<b>Número de Bonos / N. Bonds</b>						
<b>Nominal / Face value</b> (Euros)	11.036,21	113.595.709,53	24.407,31	5.223.164,34	24.356,72	4.700.846,96

**Liquidación de Intereses**  
*Interest Payment*

**Base / Day count fraction** Act / 360

**Intereses Brutos / Gross Interest** 0,000000 0,00 7,609657 1.628,47 39,961259 7.712,52

**Retención / Withholding tax** 19,00% 0,000000 0,00 1,445835 309,41 7,592639 1.465,38

**Intereses Netos / Net Interest** 0,000000 0,00 6,163822 1.319,06 32,368620 6.247,14

**Amortización de Principal**  
*Principal Redemption*

**Amortización / Redemption** (Euros) **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.4.2.1 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.