

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 **26.06.2020**

Periodo de Interés / Interest accrual period desde / From **26.03.2020** (incluido) / (included)
hasta / To **26.06.2020** (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
ES0313547004	ES0313547012	ES0313547020

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	24.03.2020	-0,373%	-0,373%	-0,373%
Margen / Margin		0,210%	0,550%	1,200%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,163%	0,177%	0,827%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,177%	0,827%

Número de Bonos / N.Bonds	Nominal / Face value	Bono Serie		Bono Serie		Bono Serie	
		Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	(Euros)	11.102,91	4.718 52.383.529,38	24.245,23	130 3.151.879,90	24.016,50	52 1.248.858,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction	Act /	360				
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	10,966926	1.425,70	50,757539
Retención / Withholding tax	19,0%	0,000000	0,00	2,083716	270,88	9,643932
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	8,883210	1.154,82	41,113607

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.4.2.1 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.