

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 **28.09.2020**

Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From **26.06.2020** (incluido) / (included)
hasta / To **28.09.2020** (excluido) / (excluded)
plazo / Term **94** días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0313547004	ES0313547012	ES0313547020

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	24.06.2020	-0,398%	-0,398%	-0,398%
Margen / Margin		0,210%	0,550%	1,200%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,188%	0,152%	0,802%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,152%	0,802%

	Bono		Bono		Bono	
	Serie		Serie		Serie	
Número de Bonos / N. Bonds		4.718		130		52
Nominal / Face value (Euros)	10.324,82	48.712.500,76	24.245,23	3.151.879,90	24.016,50	1.248.858,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction	Act /	360					
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	9,622662	1.250,95	50,293220	2.615,25
Retención / Withholding tax	19,0%	0,000000	0,00	1,828306	237,68	9,555712	496,90
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	7,794356	1.013,27	40,737508	2.118,35

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar
	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>

* 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.