

**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**
**17.07.2020**
**Periodo de Interés /**  
*Interest accrual period*
**desde / From** 17.04.2020 **(incluido) / (included)**  
**hasta / To** 17.07.2020 **(excluido) / (excluded)**  
**plazo / Term** 91 **días / days**

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0374306001	ES0374306019	ES0374306027

**Determinación Tipo Interés Nominal**
*Nominal Interest Rate Calculation*

<b>Euribor 3 Meses / 3 Months Euribor</b>	15.04.2020	-0,250%	-0,250%	-0,250%
<b>Margen / Margin</b>		0,180%	0,400%	0,950%
<b>Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate</b>		<b>-0,070%</b>	<b>0,150%</b>	<b>0,700%</b>

**Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate**

<b>0,000%*</b>	<b>0,150%</b>	<b>0,700%</b>
----------------	---------------	---------------

**Número de Bonos / N. Bonds**  
**Nominal / Face value**
**(Euros)**

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	9.091		285		124
8.584,92	78.045.507,72	19.969,34	5.691.261,90	20.799,36	2.579.120,64

**Liquidación de Intereses**
*Interest Payment*
**Base / Day count fraction**
**Act /**
**360**
**Intereses Brutos / Gross Interest**
**(Euros)**
**0,000000** 0,00 **7,571708** 2.157,94 **36,803312** 4.563,61

**Retención / Withholding tax**
**19,00%**
**0,000000** 0,00 **1,438625** 410,01 **6,992629** 867,09

**Intereses Netos / Net Interest**
**0,000000** 0,00 **6,133083** 1.747,93 **29,810683** 3.696,52

**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 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.

C/ Lagasca, 120 -MADRID, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67

info@edt-sg.com

www.edt-sg.com