

**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**
**25.05.2020**
**Periodo de Interés / Interest accrual period**

 desde / From **25.02.2020** (incluido) / (included)  
 hasta / To **25.05.2020** (excluido) / (excluded)  
 plazo / Term **90** días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E	Bonos Serie F
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds	Series F Bonds
ES0361795000	ES0361795018	ES0361795026	ES0361795034	ES0361795042	ES0361795059

**Determinación Tipo Interés Nominal**  
*Nominal Interest Calculation*
**Euribor 3 meses / 3 Month Euribor**  
**Margen / Margin**

21/02/2020	-0,415%	-0,415%	-0,415%	-0,415%	-0,415%	-0,415%
	0,150%	0,240%	0,340%	0,500%	1,850%	4,000%

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

-0,265%	-0,175%	-0,075%	0,085%	1,435%	3,585%
<b>0,000%*</b>	<b>0,000%*</b>	<b>0,000%*</b>	<b>0,085%</b>	<b>1,435%</b>	<b>3,585%</b>

**Número de Bonos / N. Bonds**  
**Nominal / Face value**

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	7.544		132		104		88		132		92	
(Euros)	7.993,86	60.305.679,84	21.216,15	2.800.531,80	21.216,15	2.206.479,60	29.619,49	2.606.515,12	100.000,00	13.200.000,00	54.347,83	5.000.000,36

**Liquidación de Intereses**  
*Interest Payment*
**Base / Day count fraction**
**Act /**
**360**
**Intereses Brutos / Gross Interest**  
**Retención / Withholding tax**  
**Intereses Netos / Net Interest**

(Euros)	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	6,294142	553,88	358,750000	47.355,00	487,092426	44.812,50
19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	1,195887	105,24	68,162500	8.997,45	92,547561	8.514,38
	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	5,098255	448,64	290,587500	38.357,55	394,544865	36.298,12

**Amortización de Principal**  
*Principal Redemption*
**Amortización / Redemption**

(Euros)	A determinar / To Be Determined	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
---------	---------------------------------	------	------	------	------	------	------	------	------	------	------	------

**Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles**  
*Payments not made due to insufficient Available Funds*
**(Euros)**
**Fecha vencimiento / Maturity date**
**Amortización de Principal / Principal Redemption**
**Intereses Brutos / Gross Interest**
**Retención / Withholding tax**
**Intereses Netos / Net Interest**
**19,00%**
**25.11.2019 / 25.02.2020**
**990,981352** 91.170,28

**188,286457** 17.322,36

**802,694895** 73.847,92

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