

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*

21.09.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / *From*
hasta / *To*
plazo / *Term*

22.06.2020 (incluido) / *(included)*
21.09.2020 (excluido) / *(excluded)*
91 días / *days*

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Series A2 Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>	<i>Series E Bonds</i>
ES0313529010	ES0313529028	ES0313529036	ES0313529044	ES0313529051

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / *3 Month Euribor* 18.06.2020
Margen / *Margin*
Tipo de interés calculado / *Calculated interest rate*
Tipo de interés aplicable / *Applicable interest rate*

-0,389%	-0,389%	-0,389%	-0,389%	-0,389%
0,160%	0,290%	0,700%	2,000%	3,900%
-0,229%	-0,099%	0,311%	1,611%	3,511%
0,000%*	0,000%*	0,311%	1,611%	3,511%

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

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	15.754	207	224	191	224				
17.622,30	277.621.714,20	41.254,26	8.539.631,82	41.255,48	9.241.227,52	41.259,46	7.880.556,86	49.841,08	11.164.401,92

Liquidación de Intereses

Interest Payment (Euros)
Base / *Day count fraction* Act / 360

Intereses Brutos / *Gross Interest*
Retención / *Withholding tax* 19%
Intereses Netos / *Net Interest*

0,000000	0,00	0,000000	0,00	32,432537	7.264,89	168,018836	32.091,60	442,340969	99.084,38
0,000000	0,00	0,000000	0,00	6,162182	1.380,33	31,923579	6.097,40	84,044784	18.826,03
0,000000	0,00	0,000000	0,00	26,270355	5.884,56	136,095257	25.994,20	358,296185	80.258,35

Amortización de Principal

Principal Redemption (Euros)

Amortización / *Redemption*

A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	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>	<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 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.*