

**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**
**26.10.2020**
**Periodo de Interés / Interest accrual period**

 desde / From  
 hasta / To  
 plazo / Term

**27.07.2020** (incluido) / (included)  
**26.10.2020** (excluido) / (excluded)  
 91 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>	<i>Series E Bonds</i>
ES0312887005	ES0312887013	ES0312887021	ES0312887039	ES0312887047

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

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	23.07.2020	-0,453%	-0,453%	-0,453%	-0,453%	-0,453%
Margen / Margin		0,110%	0,230%	0,450%	1,750%	3,500%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,343%	-0,223%	-0,003%	1,297%	3,047%

**Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate**

	<b>0,000%*</b>	<b>0,000%*</b>	<b>0,000%*</b>	<b>1,297%</b>	<b>3,047%</b>
--	----------------	----------------	----------------	---------------	---------------

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

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	
	15.617	602	149	132	301					
(Euros)	10.313,30	161.062.806,10	100.000,00	60.200.000,00	100.000,00	14.900.000,00	100.000,00	13.200.000,00	93.355,49	28.100.002,49

**Liquidación de Intereses**  
*Interest Payment*

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	327,852778	43.276,57	719,036950	216.430,12
Retención / Withholding tax	19%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	62,292028	8.222,55	136,617021	41.121,72
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	265,560750	35.054,02	582,419929	175.308,40

**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
---------------------------	---------	--------------	------------------	------	------	------	------	------	------	------	------

\* 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.