

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

15.06.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From 16.03.2020 (incluido) / (included)
hasta / To 15.06.2020 (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
ES0313548002	ES0313548010	ES0313548028

Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	12/03/2020	-0,489%	-0,489%	-0,489%
Margen / Margin		0,170%	0,480%	1,000%
Tipo de interes calculado / Calculated interest rate		-0,319%	-0,009%	0,511%
Tipo de interes aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,511%

	Bono		Bono		Bono		
	Bond	Serie	Bond	Serie	Bond	Serie	
Número de Bonos / N.Bonds		10.293		214		193	
Nominal / Face value	(Euros)	11.722,05	120.655.060,65	24.407,31	5.223.164,34	24.356,72	4.700.846,96

Liquidación de Intereses Interest Payment

Base / Day count fraction	Act /	360					
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	31,461440	6.072,06
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	5,977674	1.153,69
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	25,483766	4.918,37

Amortización de Principal Principal Redemption

Amortización / Redemption	(Euros)	A determinar To be determined	A determinar To be determined	A determinar To be determined	A determinar To be determined	A determinar To be determined	A determinar 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.