

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 hasta / To plazo / Term

25.02.2020 (incluido) / (included)
25.05.2020 (excluido) / (excluded)
90 días / days

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Bonos Serie A2 Series A2 Bonds ES0312886015	Bonos Serie B Series B Bonds ES0312886023	Bonos Serie C Series C Bonds ES0312886031	Bonos Serie D Series D Bonds ES0312886049
---	---	---	---

Eurbor 3 meses / 3 Month Eurbor

-0,415%

-0,415%

-0,415%

-0,415%

Margen / Margin

0,180%

0,390%

0,780%

2,500%

Tipo de interés calculado
Calculated interest rate

-0,235%

-0,025%

0,365%

2,085%

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable Interest rate

0,000%*

0,000%*

0,365%

2,085%

Número de Bonos / N. Bonds
Nominal / Face value

11.899,55 198.746,284,10

16,702 22.839,16

9,112.824,84 22.836,76

5.435,148,88 22.842,70

3.677.674,70 161

Liquidación de Intereses
Interest Payment
Base / Day count fraction

(Euros)
360

Intereses Brutos / Gross
Retención / Withholding tax
Intereses Netos / Net Interest

0,000000
0,000000
0,000000

0,00
0,00
0,00

0,000000
0,000000
0,000000

0,00
0,00
0,00

20,838544
3,989323
16,879221

4.959,57
942,32
4.017,25

119,067574
22,622839
96,444735

19,169,88
3.642,28
15.527,60

Amortización / Redemption

(Euros)

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.

Jose Vazquez

