

**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**
**25.11.2020**
**Periodo de Interés / Interest accrual period**

desde / From  
hasta / To  
plazo / Term

**25.08.2020** (incluido) / (included)  
**25.11.2020** (excluido) / (excluded)  
92 días / days

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

**Determinación Interés Nominal**  
*Nominal Interest Calculation*
**Euribor 3 meses / 3 Month Euribor** 21.08.2020  
**Margen / Margin**

-0,487%      -0,487%      -0,487%      -0,487%  
0,180%      0,390%      0,780%      2,500%

**Tipo de interés calculado**  
*Calculated interest rate*

-0,307%      -0,097%      0,293%      2,013%

**Tipo de Interés Nominal aplicable**  
*Applicable interest rate*
**0,000%\***      **0,000%\***      **0,293%**      **2,013%**
**Número de Bonos / N.Bonds**  
**Nominal / Face value** (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	16.702		399		238		161
11.014,91	183.971.026,82	22.057,36	8.800.886,64	22.055,04	5.249.099,52	22.060,78	3.551.785,58

**Liquidación de Intereses**  
*Interest Payment* (Euros)

**Base / Day count fraction** Act / **360**
**Intereses Brutos / Gross**  
**Retención / Withholding tax** 19,00%  
**Intereses Netos / Net Interest**

0,000000      0,00      0,000000      0,00      16,514324      3.930,41      113,488006      18.271,57  
0,000000      0,00      0,000000      0,00      3,137722      746,78      21,562721      3.471,60  
0,000000      0,00      0,000000      0,00      13,376602      3.183,63      91,925285      14.799,97

**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**

\* 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.