

**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*

25.08.2020

Periodo de Interés /  
*Interest accrual period*

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

25.05.2020 (incluido) / *(included)*  
25.08.2020 (excluido) / *(excluded)*  
92 días / *days*

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
<i>Series A2 Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>
ES0312886015	ES0312886023	ES0312886031	ES0312886049

Determinación Interés Nominal  
*Nominal Interest Calculation*

Euribor 3 meses / *3 Month Euribor* 21.05.2020  
Margen / *Margin*

-0,282% -0,282% -0,282% -0,282%

Tipo de interés calculado  
*Calculated interest rate*

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

Tipo de Interés Nominal aplicable  
*Applicable interest rate*

0,000%\* 0,108% 0,498% 2,218%

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

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>
	16.702		399		238		161
11.492,22	191.943.058,44	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 6,087831 2,429,04 28,068714 6,680,35 125,045403 20,132,31  
0,000000 0,00 1,156688 461,52 5,333056 1.269,27 23,758627 3,825,14  
0,000000 0,00 4,931143 1.967,52 22,735658 5.411,08 101,286776 16.307,17

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.