

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*

15.07.2020

Periodo de interés /
Interest accrual period

desde / *From*
15.04.2020
hasta / *To*
15.07.2020
plazo / *Term*
91

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

Bonos Serie A2a	Bonos Serie A2b	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Series A2a Bonds</i>	<i>Series A2b Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>	<i>Series E Bonds</i>
ES0345721015	ES0345721023	ES0345721031	ES0345721049	ES0345721056	ES0345721064

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor
Margen / *Margin*
Tipo de interés calculado / *Calculated interest rate*
Tipo de interés aplicable / *Applicable interest rate*

08.04.2020

-0,254%	-0,254%	-0,254%	-0,254%	-0,254%	-0,254%
0,130%	0,130%	0,170%	0,290%	0,530%	4,500%
-0,124%	-0,124%	-0,084%	0,036%	0,276%	4,246%
0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,036%	0,276%	4,246%

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

(Euros)

Bono	Serie	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>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
	5.000		2.362		220		183		235		160
14.158,74	70.793.700,00	14.158,74	33.442.943,88	100.000,00	22.000.000,00	100.000,00	18.300.000,00	100.000,00	23.500.000,00	100.000,00	16.000.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / *Day count fraction*

360

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

19,00%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	9,100000	1.665,30	69,766667	16.395,17	1.073,294444	171.727,11
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	1,729000	316,41	13,255667	3.115,08	203,925944	32.628,15
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	7,371000	1.348,89	56,511000	13.280,09	869,368500	139.098,96

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / *Redemption*

(Euros)

A determinar / <i>To be determined</i>	A determinar / <i>To be determined</i>	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
--	--	------	------	------	------	------	------	------	------	------	------

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments not made due to insufficient Available Funds

Fecha de Vencimiento / *Maturity date*

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

(Euros)

19,00%

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments outstanding due to insufficient Available Funds
Interest Payment of deferred unpaid interest

Fecha de Vencimiento / *Maturity Date*

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

(Euros)

19,00%

15.01.2009-15.04.2020

57.279,064444 9.164.650,30
10.883,022244 1.741.283,55
46.396,042200 7.423.366,75

15.01.2009-15.04.2020

16.032,818938 2.565.251,03
3.046,235598 487.397,70
12.986,583340 2.077.853,33

* 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 4.8 de la Nota de Valores y 3.4.6.1 del Módulo Adicional a la Nota de Valores 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 4.8 of the Securities Note and 3.4.6.1 of the Securities Note Building Block do not provide for the possibility of a negative Nominal Interest Rate which might result in interest being payable by Bondholders to the Fund.