

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 15.12.2020

Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From 15.09.2020 (incluido) / (included)
hasta / To 15.12.2020 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0313548002	ES0313548010	ES0313548028

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	11/09/2020	-0,484%	-0,484%	-0,484%
Margen / Margin		0,170%	0,480%	1,000%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,314%	-0,004%	0,516%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,516%

	Bono		Bono		Bono	
	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
Número de Bonos / N. Bonds		10.293		214		193
Nominal / Face value (Euros)	10.564,78	108.743.280,54	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	31,769282
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	6,036164
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	25,733118

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros)	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar
	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>

* 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.