

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption

FECHA DE PAGO / Payment date

27.12.2019

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 25.09.2019 (incluido) / (included)
hasta / To 27.12.2019 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 93 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0312888011	ES0312888029	ES0312888037	ES0312888045	ES0312888052

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

23.09.2019

Margen / Margin

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,400%	-0,400%	-0,400%	-0,400%	-0,400%
0,130%	0,280%	0,560%	2,500%	4,000%
-0,270%	-0,120%	0,160%	2,100%	3,600%

Tipo de Interes Nominal aplicable

Applicable Interest Rate

0,000%*	0,000%*	0,160%	2,100%	3,600%
---------	---------	--------	--------	--------

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
18.889,09	17.000	100.000,00	520	100.000,00	250	100.000,00	230	100.000,00	226
321.114.530,00		52.000.000,00		25.000.000,00		23.000.000,00		22.600.000,00	

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

19,00%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	41,333333	10.333,33	542,500000	124.775,00	930,000000	210.180,00
0,000000	0,00	0,000000	0,00	7,853333	1.963,33	103,075000	23.707,25	176,700000	39.934,20
0,000000	0,00	0,000000	0,00	33,480000	8.370,00	439,425000	101.067,75	753,300000	170.245,80

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined

0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles

Intereses Impagados Periodos Anteriores

Payments outstanding due to insufficient Available Funds

Unpaid Interest from previous periods

(Euros)

Fecha de vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

19,00%

25.06.2008 / 25.09.2019

54.271,274902	12.265.308,13
10.311,542232	2.330.408,55
43.959,732670	9.934.899,58

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles

Intereses por Aplazamiento de Intereses Impagados

Payments outstanding due to insufficient Available Funds

Interest Payment of deferred unpaid interest

(Euros)

Fecha de vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

19,00%

25.06.2008 / 25.09.2019

14.379,824027	3.249.840,23
2.732,166565	617.469,64
11.647,657462	2.632.370,59

* 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 3.4.6.2.1 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 3.4.6.2.1 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.