

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 16.09.2019

Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From 17.06.2019 (incluido) / (included)
hasta / To 16.09.2019 (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 13/06/2019 -0,318% -0,318% -0,318%

Margen / Margin 0,170% 0,480% 1,000%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,148% 0,162% 0,682%

Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate 0,000%* 0,162% 0,682%

Número de Bonos / N.Bonds (Euros) 13.156,38 135.418.619,34 28.515,35 6.102.284,90 28.456,25 5.492.056,25

Nominal / Face value (Euros) 10.293 214 193

Liquidación de Intereses

Interest Payment (Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest 0,000000 0,00 11,677036 2.498,89 49,056994 9.468,00

Retención / Withholding tax 19,00% 0,000000 0,00 2,218637 474,79 9,320829 1.798,92

Intereses Netos / Net Interest 0,000000 0,00 9,458399 2.024,10 39,736165 7.669,08

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros) A determinar A determinar A determinar A determinar A determinar A determinar
To be determined To be determined To be determined To be determined To be determined 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.