

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

23.12.2019

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 23.09.2019 (incluido) / (included)
hasta / To 23.12.2019 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 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
ES0313529010	ES0313529028	ES0313529036	ES0313529044	ES0313529051

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 19.09.2019 -0,396%
Margen / Margin 0,160%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,236%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate 0,000%*

-0,396%	-0,396%	-0,396%	-0,396%	-0,396%
0,160%	0,290%	0,700%	2,000%	3,900%
-0,236%	-0,106%	0,304%	1,604%	3,504%
0,000%*	0,000%*	0,304%	1,604%	3,504%

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

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	15.754		207		224		191		224
20.210,69	318.399.210,26	41.254,26	8.539.631,82	41.255,48	9.241.227,52	41.259,46	7.880.556,86	49.841,08	11.164.401,92

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest 0,000000
Retención / Withholding tax 19% 0,000000
Intereses Netos / Net Interest 0,000000

0,000000	0,00	0,000000	0,00	31,702544	7.101,37	167,288773	31.952,16	441,459059	98.886,83
0,000000	0,00	0,000000	0,00	6,023483	1.349,26	31,784867	6.070,91	83,877221	18.788,50
0,000000	0,00	0,000000	0,00	25,679061	5.752,11	135,503906	25.881,25	357,581838	80.098,33

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar To be determined A determinar To be determined A determinar To be determined A determinar To be determined 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.