

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

15.10.2019

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 15.07.2019 (incluido) / (included)
hasta / To 15.10.2019 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 92 días / days

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

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	11.07.2019	-0,364%	-0,364%	-0,364%	-0,364%	-0,364%	-0,364%
Margen / Margin		0,130%	0,130%	0,170%	0,290%	0,530%	4,500%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,234%	-0,234%	-0,194%	-0,074%	0,166%	4,136%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,166%	4,136%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series

Número de Bonos / N.Bonds		5.000	2.362	220	183	235	160						
Nominal / Face value	(Euros)	16.392,63	81.963.150,00	16.392,63	38.719.392,06	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

Base / Day count fraction	Act /	360											
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	42,422222	9.969,22	1.056,977778	169.116,44
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	8,060222	1.894,15	200,825778	32.132,12
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	34,362000	8.075,07	856,152000	136.984,32

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption	(Euros)	A determinar / To be determined	A determinar / To be determined	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	(Euros)												
Intereses Netos / Net Interest	19,00%												

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

Fecha de Vencimiento / Maturity Date

Intereses Brutos / Gross Interest													
Retención / Withholding tax	(Euros)												
Intereses Netos / Net Interest	19,00%												

* 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.