

**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**

**22.11.2019**

**Periodo de Interés / Interest accrual period**

desde / From **22.08.2019** (incluido) / (included)  
hasta / To **22.11.2019** (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series A3 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0312872015	ES0312872023	ES0312872031	ES0312872049	ES0312872056	ES0312872064

**Determinación Tipo Interés Nominal**  
*Nominal Interest Rate Calculation*

**Euribor 3 meses / 3 Month Euribor** 20/08/2019 -0,421%  
**Margen / Margin** 0,120%  
**Tipo de interés calculado / Calculated interest rate** -0,301%

-0,421%	-0,421%	-0,421%	-0,421%	-0,421%	-0,421%
0,120%	0,190%	0,270%	0,500%	1,900%	4,000%
-0,301%	-0,231%	-0,151%	0,079%	1,479%	3,579%

**Tipo de Interés Nominal aplicable**  
*Applicable interest rate*

0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,079%	1,479%	3,579%
---------	---------	---------	--------	--------	--------

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

15.156,51	15.370	232.955.558,70	5.000	97.199,77	485.998.850,00	100.000,00	650	650.000,00	100.000,00	520	520.000,00	100.000,00	260	260.000,00	100.000,00	310	310.000,00
-----------	--------	----------------	-------	-----------	----------------	------------	-----	------------	------------	-----	------------	------------	-----	------------	------------	-----	------------

**Liquidación de Intereses**  
*Interest Payment* (Euros)

**Base / Day count fraction** Act / 360  
**Intereses Brutos / Gross Interest**  
**Retención / Withholding tax** 19,00%  
**Intereses Netos / Net Interest**

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	20,188889	10.498,22	377,966667	98.271,33	914,633333	283.536,33
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	3,835889	1.994,66	71,813667	18.671,55	173,780333	53.871,90
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	16,353000	8.503,56	306,153000	79.599,78	740,853000	229.664,43

**Amortización de Principal**  
*Principal Redemption*

**Amortización / Redemption** (Euros)

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 0,00 0,00 0,00

**Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles**  
*Payments outstanding due to insufficient Available Funds* (Euros)

**Fecha de Vencimiento / Maturity date**  
**Intereses Brutos / Gross Interest**  
**Retención / Withholding tax** 19,00%  
**Intereses Netos / Net Interest**

24.02.2014 / 22.08.2019		22.08.2013 / 22.08.2019		24.11.2008 / 22.08.2019	
2.081.605556	1.082.434,90	11.323,849999	2.944.201,01	49.339.629660	15.295.285,17
395,505056	205.662,64	2.151,531499	559.398,18	9.374,529633	2.906.104,18
1.686,100500	876.772,26	9.172,318500	2.384.802,83	39.965,100027	12.389.180,99

\* 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.