

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

27.05.2019

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 26.02.2019 (incluido) / (included)
 hasta / To 27.05.2019 (excluido) / (excluded)
 plazo / Term 90 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0313546006	ES0313546014	ES0313546022

Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 22.02.2019 -0,310%
 Margen / Margin 0,230%
 Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,080%
 Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate

-0,310%	-0,310%	-0,310%
0,230%	0,600%	1,350%
-0,080%	0,290%	1,040%
0,000%*	0,290%	1,040%

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / F Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	12.953		277		270
12.806,13	165.877.801,89	26.716,34	7.400.426,18	26.740,47	7.219.926,90

Liquidación de Intereses Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360 (Euros)

Intereses Brutos / Gross Interest	0,000000	0,00	19,369347	5.365,31	69,525222	18.771,81
Retención / Withholding tax	19%	0,000000	0,00	3,680176	1.019,41	13,209792
Intereses Netos / Net Interest	0,000000	0,00	15,689171	4.345,90	56,315430	15.205,17

Amortización de Principal Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption	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 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 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.