

## 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

20.01.2020

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 21.10.2019 (incluido) / (included)  
hasta / To 20.01.2020 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 91 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
ES0366367011	ES0366367029	ES0366367037	ES0366367045	ES0366367052	ES0366367060

### Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor	17/10/2019	-0,410%	-0,410%	-0,410%	-0,410%	-0,410%	-0,410%
Margen / Margin		0,130%	0,140%	0,250%	0,550%	2,000%	4,000%
Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate		-0,280%	-0,270%	-0,160%	0,140%	1,590%	3,590%
Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,140%	1,590%	3,590%

	Bono		Bono		Bono		Bono		Bono		Bono	
	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
Número de Bonos / N.Bonds	8.024		3.500		273		156		72		234	
Nominal / Face value (Euros)	18.321,03	147.007.944,72	18.321,03	64.123.605,00	37.291,72	10.180.639,56	37.291,72	5.817.508,32	100.000,00	7.200.000,00	25.000,00	5.850.000,00

### 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	13,197125	2.058,75	401,916667	28.938,00	226,868056	53.087,13
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	2,507454	391,16	76,364167	5.498,22	43,104931	10.086,55
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	10,689671	1.667,59	325,552500	23.439,78	183,763125	43.000,58

### Amortización de Principal

Principal Redemption

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

\* 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.