

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

21.02.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period desde / From
hasta / To
plazo / Term

21.11.2019 (incluido) / (included)
21.02.2020 (excluido) / (excluded)
92 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
ES0313714018	ES0313714026	ES0313714034	ES0313714042	ES0313714059

Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 19.11.2019 -0,408%
Margen / Margin 0,140%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,268%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate 0,000%*

-0,408%	-0,408%	-0,408%	-0,408%	-0,408%
0,140%	0,300%	0,550%	2,250%	3,900%
-0,268%	-0,108%	0,142%	1,842%	3,492%
0,000%*	0,000%*	0,142%	1,842%	3,492%

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
	8.168		156		153		98		125
23.013,77	187.976.473,36	46.645,83	7.276.749,48	46.640,63	7.136.016,39	46.650,71	4.571.769,58	49.700,00	6.212.500,00

Liquidación de Intereses Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest 0,000000
Retención / Withholding tax 19,00% 0,000000
Intereses Netos / Net Interest 0,000000

0,000000	0,00	0,000000	0,00	16,925366	2.589,58	219,600442	21.520,84	443,522800	55.440,35
0,000000	0,00	0,000000	0,00	3,215820	492,02	41,724084	4.088,96	84,269332	10.533,67
0,000000	0,00	0,000000	0,00	13,709546	2.097,56	177,876358	17.431,88	359,253468	44.906,68

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	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 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.