

FECHA DE PAGO / Payment date

15.01.2020

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

15.10.2019 (incluido) / (included)
15.01.2020 (excluido) / (excluded)
92 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
Series A2 Bonds	Series A3 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds
ES0345672010	ES0345672028	ES0345672036	ES0345672044	ES0345672051

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 11.10.2019 -0,418%
Margen / Margin 0,130%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,288%
Tipo de interés Nominal aplicable / Applicable interest rate 0,000%*

-0,418%	-0,418%	-0,418%	-0,418%	-0,418%
0,130%	0,160%	0,260%	0,500%	4,500%
-0,288%	-0,258%	-0,158%	0,082%	4,082%
0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,082%	4,082%

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
	10.832	2.000	528	640	280				
20.035,24	217.021.719,68	3.420,88	6.841.760,00	100.000,00	52.800.000,00	100.000,00	64.000.000,00	100.000,00	28.000.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

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

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	20,955556	13.411,56	1,043,177778	292.089,78
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	3,981656	2.548,20	198,203778	55.497,06
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	16,974000	10.863,36	844,974000	236.592,72

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

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments not made due to insufficient Available Funds

(Euros)

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

15.10.2010-15.10.2019	15.01.2010-15.10.2019	15.01.2009-15.10.2019
4.480,750000	2.365,836,00	7.426,966424
851,342500	449,508,84	1.411,123620
3.629,407500	1.916,327,16	6.015,842804
		4.753.258,51
		903.119,12
		3.850.139,39
		55.196,717222
		2.936.465,35
		44.709,340950
		15.455.080,82
		2.936.465,35
		12.518.615,47

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

(Euros)

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

15.10.2010-15.10.2019	15.01.2010-15.10.2019	15.01.2009-15.10.2019
93,927462	49,593,70	264,670547
17,846218	9,422,80	50,287404
76,081244	40,170,90	214,383143
		169.389,15
		32.183,94
		137.205,21
		14.872,591250
		4.164.325,55
		791.221,85
		3.373.103,70

* 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.