

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

15.01.2020

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 15.10.2019 (incluido) / (included)
 hasta / To 15.01.2020 (excluido) / (excluded)
 plazo / Term 92 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
ES0345721015	ES0345721023	ES0345721031	ES0345721049	ES0345721056	ES0345721064

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor
 Margen / Margin
 Tipo de interés calculado / Calculated interest rate
 Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate

11.10.2019	-0,418%	-0,418%	-0,418%	-0,418%	-0,418%	-0,418%
	0,130%	0,130%	0,170%	0,290%	0,530%	4,500%
	-0,288%	-0,288%	-0,248%	-0,128%	0,112%	4,082%
	0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,112%	4,082%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	5.000		2.362		220		183		235		160	
Número de Bonos / N. Bonds												
Nominal / Face value	15.621,39	78.106.950,00	15.621,39	36.897.723,18	100.000,00	22.000.000,00	100.000,00	18.300.000,00	100.000,00	23.500.000,00	100.000,00	16.000.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction Act /

(Euros) 360

Intereses Brutos / Gross Interest
 Retención / Withholding tax
 Intereses Netos / Net Interest

19,00%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	28,622222	6.726,22	1.043,177778	166.908,44
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	5,438222	1.277,98	198,203778	31.712,60
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	23,184000	5.448,24	844,974000	135.195,84

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

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	0,00	0,00
---------------------------------	---------------------------------	------	------	------	------	------	------	------	------	------	------

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

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest
 Retención / Withholding tax
 Intereses Netos / Net Interest

(Euros) 19,00%

15.01.2009-15.10.2019	
55.196,717222	8.831.474,75
10.487,376272	1.677.980,20
44.709,340950	7.153.494,55

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

Fecha de Vencimiento / Maturity Date

Intereses Brutos / Gross Interest
 Retención / Withholding tax
 Intereses Netos / Net Interest

(Euros) 19,00%

15.01.2009-15.10.2019	
14.872,591250	2.379.614,60
2.825,792338	452.126,77
12.046,798912	1.927.487,83

* 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.