

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption

FECHA DE PAGO / Payment date

21.12.2018

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From 21.09.2018 (incluido) / (included)
hasta / To 21.12.2018 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 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
ES0313529010	ES0313529028	ES0313529036	ES0313529044	ES0313529051

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 19.09.2018 -0,318%

Margen / Margin 0,160%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,158%

Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate 0,000%*

-0,318%	-0,318%	-0,318%	-0,318%	-0,318%
0,290%	0,290%	0,700%	2,000%	3,900%
-0,028%	-0,028%	0,382%	1,682%	3,582%
0,000%*	0,000%*	0,382%	1,682%	3,582%

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
	15.754		207		224		191		224
23.195,36	365.419.701,44	45.865,63	9.494.185,41	45.866,99	10.274.205,76	45.871,41	8.761.439,31	52.430,48	11.744.427,52

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest 0,000000 0,00 0,000000 0,00 44,289675 9.920,89 195,032493 37.251,21 474,731781 106.339,92

Retención / Withholding tax 19% 0,000000 0,00 0,000000 0,00 8,415038 1.884,97 37,056174 7.077,73 90,199038 20.204,58

Intereses Netos / Net Interest 0,000000 0,00 0,000000 0,00 35,874637 8.035,92 157,976319 30.173,48 384,532743 86.135,34

Amortización de Principal

Principal Redemption

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

* 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.4.2.1 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.4.2.1 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.

COMUNICACIÓN DE OPERACIONES FINANCIERAS

CÓDIGO ENTIDAD PAGADORA

0049

CÓDIGO ISIN.....

ES0313529010

FECHA DE PAGO.....

21/12/2018

TIPO DE INTERÉS.....

0,000%

IMPORTE UNITARIO BRUTO CUPÓN....

0,000000

IMPORTE UNITARIO NETO CUPÓN.....

0,000000

IMPORTE UNIT.AMORT.REDUCCIÓN
NOMINAL.....

A determinar

IMPORTE UNIT.AMORT.FINAL.....

OBSERVACIONES

COMUNICACIÓN DE OPERACIONES FINANCIERAS

CÓDIGO ENTIDAD PAGADORA

0049

CÓDIGO ISIN.....

ES0313529028

FECHA DE PAGO.....

21/12/2018

TIPO DE INTERÉS.....

0,000%

IMPORTE UNITARIO BRUTO CUPÓN....

0,000000

IMPORTE UNITARIO NETO CUPÓN.....

0,000000

IMPORTE UNIT.AMORT.REDUCCIÓN
NOMINAL.....

A determinar

IMPORTE UNIT.AMORT.FINAL.....

OBSERVACIONES

COMUNICACIÓN DE OPERACIONES FINANCIERAS

CÓDIGO ENTIDAD PAGADORA

0049

CÓDIGO ISIN.....

ES0313529036

FECHA DE PAGO.....

21/12/2018

TIPO DE INTERÉS.....

0,382%

IMPORTE UNITARIO BRUTO CUPÓN....

44,289675

IMPORTE UNITARIO NETO CUPÓN.....

35,874637

IMPORTE UNIT.AMORT.REDUCCIÓN
NOMINAL.....

A determinar

IMPORTE UNIT.AMORT.FINAL.....

OBSERVACIONES

COMUNICACIÓN DE OPERACIONES FINANCIERAS

CÓDIGO ENTIDAD PAGADORA

0049

CÓDIGO ISIN.....

ES0313529044

FECHA DE PAGO.....

21/12/2018

TIPO DE INTERÉS.....

1,682%

IMPORTE UNITARIO BRUTO CUPÓN....

195,032493

IMPORTE UNITARIO NETO CUPÓN.....

157,976319

IMPORTE UNIT.AMORT.REDUCCIÓN
NOMINAL.....

A determinar

IMPORTE UNIT.AMORT.FINAL.....

OBSERVACIONES

COMUNICACIÓN DE OPERACIONES FINANCIERAS

CÓDIGO ENTIDAD PAGADORA

0049

CÓDIGO ISIN.....

ES0313529051

FECHA DE PAGO.....

21/12/2018

TIPO DE INTERÉS.....

3,582%

IMPORTE UNITARIO BRUTO CUPÓN....

474,731781

IMPORTE UNITARIO NETO CUPÓN.....

384,532743

IMPORTE UNIT.AMORT.REDUCCIÓN
NOMINAL.....

A determinar

IMPORTE UNIT.AMORT.FINAL.....

OBSERVACIONES