

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*

18.01.2019

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

18.10.2018 (incluido) / *(included)*
18.01.2019 (excluido) / *(excluded)*
92 días / *days*

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Serie A Bonds</i>	<i>Serie B Bonds</i>	<i>Serie C Bonds</i>	<i>Serie D Bonds</i>	<i>Serie E Bonds</i>
ES0374273003	ES0374273011	ES0374273029	ES0374273037	ES0374273045

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / <i>3 Month Euribor</i>	16/10/2018	-0,318%	-0,318%	-0,318%	-0,318%	-0,318%
Margen / <i>Margin</i>		0,170%	0,340%	0,550%	2,000%	4,000%
Tipo de interés calculado / <i>Calculated interest rate</i>		-0,148%	0,022%	0,232%	1,682%	3,682%
Tipo de Interés Nominal aplicable / <i>Applicable Interest Rate</i>		0,000%*	0,022%	0,232%	1,682%	3,682%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie		
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>		
	10.081	363	80	128							
Número de Bonos / <i>N.Bonds</i>											
Nominal / <i>Face value</i>	(Euros)	16.668,54	168.035.551,74	35.340,68	12.828.666,84	35.337,18	2.826.974,40	35.334,24	4.522.782,72	49.931,25	6.391.200,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / *Day count fraction*

Act / **360**

Intereses Brutos / <i>Gross Interest</i>		0,000000	0,00	1,986932	721,26	20,951021	1.676,08	151,882268	19.440,93	469,830871	60.138,35
Retención / <i>Withholding tax</i>	19,00%	0,000000	0,00	0,377517	137,04	3,980694	318,46	28,857631	3.693,78	89,267865	11.426,29
Intereses Netos / <i>Net Interest</i>		0,000000	0,00	1,609415	584,22	16,970327	1.357,62	123,024637	15.747,15	380,563006	48.712,06

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / *Redemption*

(Euros)

A determinar / *To be determined* 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