

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

17.01.2019

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

17.10.2018 (incluido) / (included)
17.01.2019 (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
ES0313270011	ES0313270029	ES0313270037	ES0313270045	ES0313270052

Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	15.10.2018	-0,318%	-0,318%	-0,318%	-0,318%	-0,318%
Margen / Margin		0,150%	0,270%	0,480%	2,250%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,168%	-0,048%	0,162%	1,932%	3,582%
Tipo de interes aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,162%	1,932%	3,582%

	Bono		Bono		Bono		Bono		Bono	
	Serie	Class	Serie	Class	Serie	Class	Serie	Class	Serie	Class
Número de Bonos / N.Bonds	13.974		224		241		205		206	
Nominal / Face value (Euros)	33.898,59	473.698.896,66	66.924,39	14.991.063,36	66.937,17	16.131.857,97	66.929,92	13.720.633,60	70.625,58	14.548.869,48

Liquidación de Intereses Interest Payment

Base / Day count fraction	Act /	360									
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	27,711988	6.678,59	330,455325	67.743,34	646,506559	133.180,35
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	5,265278	1.268,93	62,786512	12.871,23	122,836246	25.304,27
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	22,446710	5.409,66	267,668813	54.872,11	523,670313	107.876,08

Amortización de Principal Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros)	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar
	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	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.