

**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

21.01.2019

Periodo de Interés /  
Interest accrual period

desde / From 19.10.2018 (incluido) / (included)  
hasta / To 21.01.2019 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 94 días / days

Bonos Serie A2a	Bonos Serie A2b	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Serías A2a Bonds	Serías A2b Bonds	Serías B Bonds	Serías C Bonds	Serías D Bonds	Serías E Bonds
ES0366367011	ES0366367029	ES0366367037	ES0366367045	ES0366367052	ES0366367060

**Determinación Tipo Interés Nominal**  
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

17/10/2018

-0,318%

-0,318%

-0,318%

-0,318%

-0,318%

-0,318%

Margen / Margin

0,130%

0,140%

0,250%

0,550%

2,000%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate

-0,188%

-0,178%

-0,068%

0,232%

1,682%

3,682%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

0,000%\*

0,000%\*

0,000%\*

0,232%

1,682%

3,682%

Número de Bonos / N. Bonds

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	8.024		3.500		273		156		72		234
20.698,14	166.081.875,36	20.698,14	72.443.490,00	45.257,46	12.355.286,58	76.642,07	11.956.162,92	100.000,00	7.200.000,00	25.000,00	5.850.000,00

**Liquidación de Intereses**  
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest

19,00%

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	46,428063	7.242,78	439,188889	31.621,60	240,352778	56.242,55
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	8,821332	1.376,13	83,445889	6.008,10	45,667028	10.686,08
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	37,606731	5.866,65	355,743000	25.613,50	194,685750	45.556,47

**Amortización de Principal**  
Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To be determined	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
---------------------------------	---------------------------------	---------------------------------	------	------	------	------	------	------	------	------

\* 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.