

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

18.02.2019

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 19.11.2018 (incluido) / (included)
 hasta / To 18.02.2019 (excluido) / (excluded)
 plazo / Term 91 días / days

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 15.11.2018 -0,316%
 Margen / Margin 0,020%
 Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,296%
 Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate 0,000%*

Bonos Serie A3(G)	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A3(G) Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0313273023	ES0313273031	ES0313273049	ES0313273056	ES0313273064

-0,316%	-0,316%	-0,316%	-0,316%	-0,316%
0,020%	0,350%	0,900%	1,800%	3,900%
-0,296%	0,034%	0,584%	1,484%	3,584%
0,000%*	0,034%	0,584%	1,484%	3,584%

Número de Bonos / N.Bonds
 Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	912		231		60		108		174
32.694,64	29.817.511,68	100.000,00	23.100.000,00	100.000,00	6.000.000,00	100.000,00	10.800.000,00	100.000,00	17.400.000,00

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	8,594444	1.985,32	147,622222	8.857,33	375,122222	40.513,20	905,955556	157.636,27
0,000000	0,00	1,632944	377,21	28,048222	1.682,89	71,273222	7.697,51	172,131556	29.950,89
0,000000	0,00	6,961500	1.608,11	119,574000	7.174,44	303,849000	32.815,69		127.685,38

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments outstanding due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date

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

19,00%

18/08/2009 - 19/11/2018
 40.733,194443 7.087.575,82
 7.739,306943 1.346.639,39
 32.993,887500 5.740.936,43

* 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.