

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*

24.05.2018

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / *From*
hasta / *To*
plazo / *Term*

26.02.2018 (incluido) / *(included)*
24.05.2018 (excluido) / *(excluded)*
87 días / *days*

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / *3 Month Euribor*

Margen / *Margin*

Tipo de Interés Nominal calculado / *Calculated interest rate*

Tipo de Interés Nominal aplicable / *Applicable interest rate*

	Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
	<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
	ES0382744003	ES0382744011	ES0382744029
22.02.2018	-0,328%	-0,328%	-0,328%
Margen	0,185%	0,530%	1,050%
Tipo de Interés Nominal calculado	-0,143%	0,202%	0,722%
Tipo de Interés Nominal aplicable	0,000%*	0,202%	0,722%

Número de Bonos / *N.Bonds*

Nominal / *Face value*

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	4.543		118		59
9.701,06	44.071.915,58	20.188,70	2.382.266,60	20.188,70	1.191.133,30

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / *Day count fraction*

Act /

360

Intereses Brutos / *Gross Interest*

(Euros)

Retención / *Withholding tax*

19,00%

Intereses Netos / *Net Interest*

0,000000	0,00	9,855450	1.162,94	35,225917	2.078,33
0,000000	0,00	1,872536	220,96	6,692924	394,88
0,000000	0,00	7,982914	941,98	28,532993	1.683,45

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / *Redemption*

(Euros)

A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar
<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>

* 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.