

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		13.08.2018	
Periodo de Interés / Interest accrual period	desde / From	14.05.2018	(incluido) / (included)
	hasta / To	13.08.2018	(excluido) / (excluded)
	plazo / Term	91	días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Class A Bonds	Class B Bonds	Class C Bonds
ES0313920003	ES0313920011	ES0313920029

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	10.05.2018	-0,326%	-0,326%	-0,326%
Margen / Margin		0,240%	0,450%	1,250%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,086%	0,124%	0,924%
Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,124%	0,924%

Número de Bonos / N.Bonds		Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Nominal / Face value	(Euros)	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
			6.841		149		110
		10.428,47	71.341.163,27	21.693,20	3.232.286,80	21.688,50	2.385.735,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction	Act /					
	360					
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	6,799613	1.013,14	50,657107
Retención / Withholding tax	19%	0,000000	0,00	1,291926	192,50	9,624850
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	5,507687	820,65	41,032257

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption		A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar
	(Euros)	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 II.10 y V.4.2 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 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.