

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption

FECHA DE PAGO / Payment date

29.06.2018

Periodo de Interés /
Interest accrual period

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

27.06.2018 (incluido) / *(included)*
29.06.2018 (excluido) / *(excluded)*
2 días / *days*

Bonos Serie A	Bonos Serie B
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>
ES0361747001	ES0361747019

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor 25.06.2018 **-0,324%**

Margen / Margin

0,300%

0,700%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated Interest Rate

-0,024%

0,376%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

0,000%*

0,376%

Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
	2.745		1.755
Nominal / <i>Face value</i>	(Euros) 30.724,96	84.340.015,20	100.000,00
		175.500.000,00	

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest (Euros)

0,000000

0,00

2,088889

3.666,00

Retención / Withholding tax 19%

0,000000

0,00

0,396889

696,54

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

1,692000

2.969,46

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros)

A determinar / To be determined

A determinar / To be determined

Pagos no satisfechos por insuficiencia
de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient
Available Funds

Fecha de Vencimiento / Maturity date

27.06.2013 / 27.06.2018

Intereses Brutos / Gross Interest (Euros)

3.402,469445

5.971.333,88

Retención / Withholding tax 19%

646,469195

1.134.553,44

Intereses Netos / Net Interest

2.756,000250

4.836.780,44

* 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.*