

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*

26.02.2018

Periodo de Interés /
Interest accrual period

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

24.11.2017 (incluido) / *(included)*
26.02.2018 (excluido) / *(excluded)*
94 días / *days*

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

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / *3 Month Euribor*

22.11.2017

-0,329%

-0,329%

-0,329%

Margen / *Margin*

0,185%

0,530%

1,050%

Tipo de Interés Nominal calculado / *Calculated interest rate*

-0,144%

0,201%

0,721%

Tipo de Interés Nominal aplicable / *Applicable interest rate*

0,000%*

0,201%

0,721%

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
10.299,75	46.791.764,25	21.434,62	2.529.285,16	21.434,62	1.264.642,58

Número de Bonos / *N.Bonds*

Nominal / *Face value*

(Euros)

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / *Day count fraction*

Act /

360

Intereses Brutos / *Gross Interest*

(Euros)

0,000000

0,00

11,249603

1.327,45

40,353054

2.380,83

Retención / *Withholding tax*

19,00%

0,000000

0,00

2,137425

252,22

7,667080

452,36

Intereses Netos / *Net Interest*

0,000000

0,00

9,112178

1.075,23

32,685974

1.928,47

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / *Redemption*

(Euros)

A determinar

To be determined

A determinar

To be determined

A determinar

To be determined

A determinar

To be determined

A determinar

To be determined

A determinar

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.4.2.1 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.