

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 12.11.2018

Periodo de Interés / Interest accrual period desde / From 13.08.2018 (incluido) / (included) hasta / To 12.11.2018 (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	09.08.2018	-0,319%	-0,319%	-0,319%
Margen / Margin		0,240%	0,450%	1,250%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,079%	0,131%	0,931%
Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,131%	0,931%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	6.841		149		110
Número de Bonos / N. Bonds					
Nominal / Face value (Euros)	9.956,00	68.108.996,00	20.710,37	3.085.845,13	20.705,89
					2.277.647,90

Liquidación de Intereses Interest Payment

Base / Day count fraction	Act / 360				
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	6,858009	1.021,84
Retención / Withholding tax	19%	0,000000	0,00	1,303022	194,15
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	5,554987	827,69
					39,470033
					4.341,71

Amortización de Principal Principal Redemption

Amortización / Redemption	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 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.