

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

18.04.2018

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

18.01.2018 (incluido) / (included)
18.04.2018 (excluido) / (excluded)
90 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0312884002	ES0312884010	ES0312884028

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 16.01.2018 -0,329%

Margen / Margin 0,270%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,059%

Tipo de interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

0,000%* **0,321%** **0,921%**

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	9.605		245		150
9.109,00	87.491.945,00	21.820,46	5.346.012,70	21.820,46	3.273.069,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction Act / **360**

Intereses Brutos / Gross Interest (Euros) **0,000000**

Retención / Withholding tax **19,00%** **0,000000**

Intereses Netos / Net Interest **0,000000**

0,00	17,510919	4.290,18	50,241609	7.536,24
0,00	3,327075	815,13	9,545906	1.431,89
0,00	14,183844	3.475,05	40,695703	6.104,35

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros) **a determinar/to be determined** **0,00** **0,00** **0,00** **0,00**

* 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.