

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
25.10.2018
Periodo de Interés / Interest accrual period

 desde / From
 hasta / To
 plazo / Term

25.07.2018 (incluido) / (included)
25.10.2018 (excluido) / (excluded)
 92 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0312887005	ES0312887013	ES0312887021	ES0312887039	ES0312887047

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	23.07.2018	-0,321%	-0,321%	-0,321%	-0,321%	-0,321%
Margen / Margin		0,110%	0,230%	0,450%	1,750%	3,500%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,211%	-0,091%	0,129%	1,429%	3,179%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

0,000%*	0,000%*	0,129%	1,429%	3,179%
----------------	----------------	---------------	---------------	---------------

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	15.617	602		149		132		301		
Número de Bonos / N. Bonds										
Nominal / Face value	(Euros) 14.794,76	231.049.766,92	100.000,00	60.200.000,00	100.000,00	14.900.000,00	100.000,00	13.200.000,00	93.355,49	28.100.002,49

Liquidación de Intereses
Interest Payment
Base / Day count fraction Act / **360**

Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	32,966667	4.912,03	365,188889	48.204,93	758,430374	228.287,54
Retención / Withholding tax	19%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	6,263667	933,29	69,385889	9.158,94	144,101771	43.374,63
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	26,703000	3.978,74	295,803000	39.045,99	614,328603	184.912,91

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption	(Euros)	A determinar	To be determined	0,00	0,00	0,00	0,00	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.4.2.1 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.