

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

21.09.2018

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 21.06.2018 (incluido) / (included)
hasta / To 21.09.2018 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0313529010	ES0313529028	ES0313529036	ES0313529044	ES0313529051

Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	19.06.2018	-0,323%	-0,323%	-0,323%	-0,323%	-0,323%
Margen / Margin		0,160%	0,290%	0,700%	2,000%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,163%	-0,033%	0,377%	1,677%	3,577%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,377%	1,677%	3,577%

	Bono		Bono		Bono		Bono		Bono		
	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	
Número de Bonos / N. Bonds	15.754		207		224		191		224		
Nominal / Face value	(Euros)	23.652,48	372.621.169,92	53.974,49	11.172.719,43	53.976,09	12.090.644,16	53.981,29	10.310.426,39	53.810,52	12.053.556,48

Liquidación de Intereses Interest Payment

Base / Day count fraction	Act /	360										
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	52,002964	11.648,66	231,345815	44.187,05	491,893921	110.184,24	
Retención / Withholding tax	19%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	9,880563	2.213,25	43,955705	8.395,54	93,459845	20.935,01	
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	42,122401	9.435,41	187,390110	35.791,51	398,434076	89.249,23	

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	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.