

**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 27.11.2017 (incluido) / (included)  
hasta / To 26.02.2018 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E	Bonos Serie F
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds	Series F Bonds
ES0361795000	ES0361795018	ES0361795026	ES0361795034	ES0361795042	ES0361795059

Determinación Tipo Interés Nominal  
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

23/11/2017

-0,329%

-0,329%

-0,329%

-0,329%

-0,329%

-0,329%

Margen / Margin

0,150%

0,240%

0,340%

0,500%

1,850%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate

-0,179%

-0,089%

0,011%

0,171%

1,521%

3,671%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

0,000%\*

0,000%\*

0,011%

0,171%

1,521%

3,671%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie		
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series		
	7.544		132		104		88		132		92		
Número de Bonos / N.Bonds Nominal / Face value	(Euros)	12.683,09	95.681.230,96	29.619,49	3.909.772,68	29.619,49	3.080.426,96	29.619,49	2.606.515,12	100.000,00	13.200.000,00	54.347,83	5.000.000,36

Liquidación de Intereses  
Interest Payment

Base / Day count fraction Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

(Euros)

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,823586

85,65

12,803025

1.126,67

384,475000

50.750,70

504,319179

46.397,36

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,156481

16,27

2,432575

214,07

73,050250

9.642,63

95,820644

8.815,50

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,667105

69,38

10,370450

912,60

311,424750

41.108,07

408,498535

37.581,86

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

Pagos no satisfechos por insuficiencia  
de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient  
Available Funds

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity Date

27.11.2017

Intereses Brutos / Gross Interest

520,945086

47.926,95

Retención / Withholding tax

19%

98,979566

9.106,12

Intereses Netos / Net Interest

421,965520

38.820,83

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