

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

19.04.2018

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From 19.01.2018 (incluido) / (included)
hasta / To 19.04.2018 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 90 días / days

Bonos Serie A2a	Bonos Serie A2b	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2a Bonds	Series A2b Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0366367011	ES0366367029	ES0366367037	ES0366367045	ES0366367052	ES0366367060

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor 17.01.2018

-0,328%

-0,328%

-0,328%

-0,328%

-0,328%

-0,328%

Margen / Margin

0,130%

0,140%

0,250%

0,550%

2,000%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate

-0,198%

-0,188%

-0,078%

0,222%

1,672%

3,672%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

0,000%*

0,000%*

0,000%*

0,222%

1,672%

3,672%

Número de Bonos / N. Bonds

8.024

3.500

273

156

72

234

Nominal / Face value

(Euros)

21.607,03

173.374.808,72

21.607,03

75.624.605,00

100.000,00

27.300.000,00

100.000,00

15.600.000,00

100.000,00

7.200.000,00

50.000,00

11.700.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

55,500000

8.658,00

418,000000

30.096,00

459,000000

107.406,00

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

10,545000

1.645,02

79,420000

5.718,24

87,210000

20.407,14

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

44,955000

7.012,98

338,580000

24.377,76

371,790000

86.998,86

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To be determined

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 4.8 de la Nota de Valores y 3.4.6.2.1 del Módulo Adicional a la Nota de Valores 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 4.8 of the Securities Note and 3.4.6.2.1 of the Securities Note Building Block do not provide for the possibility of a negative Nominal Interest Rate which might result in interest being payable by Bondholders to the Fund.