

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

27.11.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

25.08.2017
27.11.2017
94

(incluido) / (included)
(excluido) / (excluded)
días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds
ES0312886015	ES0312886023	ES0312886031	ES0312886049

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 23.08.2017 -0,329%
Margen / Margin 0,180%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,149%

-0,329% -0,329% -0,329% -0,329%
0,180% 0,390% 0,780% 2,500%
-0,149% 0,061% 0,451% 2,171%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

0,000%* **0,061%** **0,451%** **2,171%**

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

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	16.702		399		238		161
17.129,42	286.095.572,84	32.877,00	13.117.923,00	32.873,55	7.823.904,90	32.882,11	5.294.019,71

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross 0,000000 0,00
Interés Retención / Withholding tax 19,00% 0,000000 0,00
Intereses Neto / Net 0,000000 0,00

0,000000 0,00 5,236576 2.089,39 38,712258 9.213,52 186,399548 30.010,33
0,000000 0,00 0,994949 396,98 7,355329 1.750,57 35,415914 5.701,96
0,000000 0,00 4,241627 1.692,41 31,356929 7.462,95 150,983634 24.308,37

Amortización de Principal
Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

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.