

**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

19.01.2018

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 19.10.2017 (incluido) / (included)  
hasta / To 19.01.2018 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 92 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 17.10.2017

-0,329%

-0,329%

-0,329%

-0,329%

-0,329%

-0,329%

Margen / Margin

0,130%

0,140%

0,250%

0,550%

2,000%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate

-0,199%

-0,189%

-0,079%

0,221%

1,671%

3,671%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

0,000%\*

0,000%\*

0,000%\*

0,221%

1,671%

3,671%

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	8.024		3.500		273		156		72		234
22.633,91	181.614.493,84	22.633,91	79.218.685,00	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

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

19,00%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	56,477778	8.810,53	427,033333	30.746,40	469,072222	109.762,90
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	10,730778	1.674,00	81,136333	5.841,82	89,123722	20.854,95
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	45,747000	7.136,53	345,897000	24.904,58	379,948500	88.907,95

**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	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.