

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption

MODIFICA EL PUBLICADO EL 21.09.2017 / THIS AMENDS THE PUBLISHED ON 21.09.2017

FECHA DE PAGO / Payment date

27.12.2017

Periodo de Interés /

desde / From 25.09.2017 (incluido) / (included)

Interest accrual period

hasta / To 27.12.2017 (excluido) / (excluded)

plazo / Term 93 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
ES0312888011	ES0312888029	ES0312888037	ES0312888045	ES0312888052

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

21.09.2017

-0,330%

-0,330%

-0,330%

-0,330%

-0,330%

Margen / Margin

0,130%

0,280%

0,560%

2,500%

4,000%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,200%

-0,050%

0,230%

2,170%

3,670%

Tipo de Interes Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

0,000%*

0,000%*

0,230%

2,170%

3,670%

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	17.000		520		250		230		226
25.048,27	425.820.590,00	100.000,00	52.000.000,00	100.000,00	25.000.000,00	100.000,00	23.000.000,00	100.000,00	22.600.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

59,416667

14.854,17

560,583333

128.934,17

948,083333

214.266,83

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

11,289167

2.822,29

106,510833

24.497,49

180,135833

40.710,70

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

48,127500

12.031,88

454,072500

104.436,68

767,947500

173.556,13

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles

Intereses Impagados Periodos Anteriores

Payments outstanding due to insufficient Available Funds

Unpaid Interest from previous periods

(Euros)

Fecha de vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

19,00%

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

25.06.2008 / 25.09.2017

46.817,522124

10.580.760,00

8.895,329204

2.010.344,41

37.922,192920

8.570.415,59

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles

Intereses por Aplazamiento de Intereses Impagados

Payments outstanding due to insufficient Available Funds

Interest Payment of deferred unpaid interest

(Euros)

Fecha de vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

19,00%

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

25.06.2008 / 25.09.2017

10.647,105088

2.406.245,75

2.022,949967

457.186,69

8.624,155121

1.949.059,06

* 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.