

**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**

**27.12.2017**

**Periodo de Interés / Interest accrual period**

desde / From  
hasta / To  
plazo / Term

**25.09.2017**  
**27.12.2017**  
93

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

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0312882006	ES0312882014	ES0312882022

**Determinación Interés Nominal**  
*Nominal Interest Calculation*

**Euribor 3 meses / 3 month Euribor** 21.09.2017 -0,330%

**Margen / Margin** 0,260%

**Tipo de interés calculado / Calculated interest rate** -0,070%

-0,330%

0,500%

0,170% 6,750%

**Tipo de interés Nominal aplicable / Applicable interest rate**

**0,000%\***

**0,170%**

**6,750%**

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

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	5.001		104		104
7.309,83	36.556.459,83	27.315,79	2.840.842,16	100.000,00	10.400.000,00

**Liquidación de Intereses**  
*Interest Payment*

Base / Day count fraction Act / **360**

**Intereses Brutos / Gross Interest** (Euros) **0,000000**

**Retención / Withholding tax** **19,00%** **0,000000**

**Intereses Netos / Net Interest** **0,000000**

0,00 11,996184 1.247,60 1.743,750000 181.350,00

0,00 2,279275 237,04 331,312500 34.456,50

0,00 9,716909 1.010,56 1.412,437500 146.893,50

**Amortización de Principal**  
*Principal Redemption*

**Amortización / Redemption** (Euros)

**A determinar/to be determined**

**A determinar/to be determined**

**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 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.