

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 20.11.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period
 desde / From 18.08.2017 (incluido) / (included)
 hasta / To 20.11.2017 (excluido) / (excluded)
 plazo / Term 94 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3(G)	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series A3(G) Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0313273015	ES0313273023	ES0313273031	ES0313273049	ES0313273056	ES0313273064

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	16.08.2017	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%
Margen / Margin		0,200%	0,020%	0,350%	0,900%	1,800%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,129%	-0,309%	0,021%	0,571%	1,471%	3,571%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,021%	0,571%	1,471%	3,571%

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
	2.889		912		231		60		108		174
7.086,98	20.474.285,22	36.950,70	33.699.038,40	100.000,00	23.100.000,00	100.000,00	6.000.000,00	100.000,00	10.800.000,00	100.000,00	17.400.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction	Act /	360												
Intereses Brutos / Gross Interest	Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	5,483333	1.266,65	149,094444	8.945,67	384,094444	41.482,20	932,427778	162.242,43
Intereses Brutos / Gross Interest	Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	1,041833	240,66	28,327944	1.699,68	72,977944	7.881,62	177,161278	30.826,06
Intereses Brutos / Gross Interest	Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	4,441500	1.025,99	120,766500	7.245,99	311,116500	33.600,58	755,266500	131.416,37

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption	A determinar / To be determine	A determinar / To be determin	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
---------------------------	--------------------------------	-------------------------------	------	------	------	------	------	------	------	------	------

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments outstanding due to insufficient Available Funds

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles	(Euros)										
--	---------	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest	Retención / Withholding tax	19,00%									
Intereses Brutos / Gross Interest	Retención / Withholding tax	19,00%									
Intereses Brutos / Gross Interest	Retención / Withholding tax	19,00%									

* 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.