

## 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

16.08.2017

Período de Interés / Interest accrual period

 desde / From  
hasta / To  
plazo / Term

 16.05.2017 (incluido) / (included)  
16.08.2017 (excluido) / (excluded)  
92 días / days

### Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

 Euribor 3 meses / 3 Month Euribor  
Margen / Margin  
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate  
Tipo de interés aplicable / Interest rate

	Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
11/05/2017	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%
	0,120%	0,220%	0,520%	2,100%	3,900%
	-0,209%	-0,109%	0,191%	1,771%	3,571%
	<b>0,000%*</b>	<b>0,000%*</b>	<b>0,191%</b>	<b>1,771%</b>	<b>3,571%</b>

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
6.820	162	275	107	146					
2.116,59	14.435.143,80	100.000,00	16.200.000,00	100.000,00	27.500.000,00	100.000,00	10.700.000,00	100.000,00	14.600.000,00

### Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Neto / Net Interest

19%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	48,811111	13.423,06	452,588889	48.427,01	912,588889	133.237,98
0,000000	0,00	0,000000	0,00	9,274111	2.550,38	85,991889	9.201,13	173,391889	25.315,22
0,000000	0,00	0,000000	0,00	39,537000	10.872,68	366,597000	39.225,88	739,197000	107.922,76

### 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

Payments outstanding due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Neto / Net Interest

19%

16.11.2009-16.05.2017

33.945,119445 4.955.987,43

6.449,572695 941.637,62

27.495,546750 4.014.349,81

\* 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.