

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS
Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption

FECHA DE PAGO / Payment date

27.12.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

27.09.2017 (incluido) / (included)
27.12.2017 (excluido) / (excluded)
91 días / days

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

25.09.2017

Margen / Margin

-0,329%

-0,329%

0,300%

0,700%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated Interest Rate

-0,029%

0,371%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

0,000%*

0,371%

Bonos Serie A	Bonos Serie B
Series A Bonds	Series B Bonds
ES0361747001	ES0361747019

Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series
	2.745		1.755
35.041,95	96.190.152,75	100.000,00	175.500.000,00

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value (Euros)

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest (Euros)

Retención / Withholding tax 19%

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros)

A determinar / To be determined

0,00

0,00

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient Available Funds

Available Funds

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest (Euros)

Retención / Withholding tax 19%

Intereses Netos / Net Interest

27.06.2013 / 27.09.2017

3.121,127778

5.477.579,25

593,014278

1.040.740,06

2.528,113500

4.436.839,19

* 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.