

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

25.09.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From **23.06.2017** (incluido) / (included)
hasta / To **25.09.2017** (excluido) / (excluded)
plazo / Term **94** 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	21.06.2017	-0,329%	-0,329%	
Margen / Margin		0,260%	0,500%	
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,069%	0,171%	6,750%

Tipo de interes aplicable / Interest rate

0,000%*	0,171%	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
8.059,60	40.306.059,60	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	0,00	12,196500	1.268,44	1.762,500000	183.300,00
Intereses Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	2,317335	241,00	334,875000	34.827,00
Intereses Neto / Net		0,000000	0,00	9,879165	1.027,43	1.427,625000	148.473,00

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.