

**FECHA DE PAGO:** 14.11.2016

*Payment date*

**Periodo de Devengo de Intereses** desde / from **16.08.2016** (incluido) / (included)  
*Interest accrual period* hasta / to **14.11.2016** (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 90 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>
<b>ES0358283002</b>	<b>ES0358283010</b>

**Determinación Interés Nominal**

*Nominal Interest Calculation*

**Euribor 3 meses / 3 Months Euribor** 11.08.2016  
*Margen / Spread*

-0,299%

-0,299%

0,240%

0,550%

**Tipo aplicable resultante**

*Interest Rate*

**0,000%**\*

**0,251%**

**Liquidación de Intereses**

*Interest Payment*

(euros)

**Número de Bonos / N.Bonds**

**Nominal / Face Value**

**Base / Day Count Fraction**

**Intereses Brutos / Gross Interest**

**Retención / Withholding tax**

**Neto / Net Interest**

360

**19,00%**

4.987

**6.850,77**

34.164.789,99

**0,00**

**0,00**

**0,00**

0,00

0,00

0,00

**100.000,00**

**62,75**

**11,92**

**50,83**

213

21.300.000,00

13.365,75

2.538,96

10.826,79

**Amortización de Principal**

*Principal Redemption*

(euros)

**Amortización / Redemption**

**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 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 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.*