

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

27.12.2016

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 26.09.2016 (incluido) / (included)
hasta / To 27.12.2016 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0312888011	ES0312888029	ES0312888037	ES0312888045	ES0312888052

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

22.09.2016

Margen / Margin

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,301% -0,301% -0,301% -0,301% -0,301%

0,130% 0,280% 0,560% 2,500% 4,000%

-0,171% -0,021% 0,259% 2,199% 3,699%

Tipo de Interes Nominal aplicable / Interest Rate

0,000%* 0,000%* 0,259% 2,199% 3,699%

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	17.000		520		250		230		226
28.171,28	478.911.760,00	100.000,00	52.000.000,00	100.000,00	25.000.000,00	100.000,00	23.000.000,00	100.000,00	22.600.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act /

360

Intereses Brutos / Gross

Interés Retención / Withholding tax

Neto / Net

19,00%

0,000000 0,00 0,000000 0,00 66,188889 16.547,22 561,966667 129.252,33 945,300000 213.637,80

0,000000 0,00 0,000000 0,00 12,575889 3.143,97 106,773667 24.557,94 179,607000 40.591,18

0,000000 0,00 0,000000 0,00 53,613000 13.403,25 455,193000 104.694,39 765,693000 173.046,62

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

Intereses Impagados Periodos Anteriores

Payments outstanding due to insufficient Available Funds

Unpaid Interest from previous periods

(Euros)

Fecha de vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

Interés Retención / Withholding tax

Neto / Net Interest

19,00%

25.06.2008 / 26.09.2016

43.095,833332 9.739.658,32

8.188,208332 1.850.535,09

34.907,625000 7.889.123,23

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles

Intereses por Aplazamiento de Intereses Impagados

Payments outstanding due to insufficient Available Funds

Interest Payment of deferred unpaid interest

(Euros)

Fecha de vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

Interés Retención / Withholding tax

Neto / Net Interest

19,00%

25.06.2008 / 26.09.2016

8.991,919558 2.032.173,82

1.708,464716 386.113,03

7.283,454842 1.646.060,79

* 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.