

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

26.06.2017

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From **27.03.2017** (incluido) / (included)
hasta / To **26.06.2017** (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 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
ES0361796016	ES0361796024	ES0361796032	ES0361796040	ES0361796057

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

23.03.2017

-0,330%

-0,330%

-0,330%

-0,330%

-0,330%

Margen / Margin

0,150%

0,190%

0,290%

0,500%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Interest Rate

-0,180%

-0,140%

-0,040%

0,170%

3,670%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

0,000%*

0,000%*

0,000%*

0,170%

3,670%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series

Número de Bonos / N.Bonds

(Euros)

6.680

132

116

72

100

Nominal / Face value

(Euros)

25.356,45

169.381.086,00

53.296,87

7.035.186,84

100.000,00

11.600.000,00

100.000,00

7.200.000,00

100.000,00

10.000.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

(Euros)

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

42,972222

3.094,00

927,694444

92.769,44

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

8,164722

587,86

176,261944

17.626,19

Neto / Net

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

34,807500

2.506,14

751,432500

75.143,25

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient Available Funds

Fecha de Vencimiento / Maturity Date

Intereses Brutos / Gross Interest

(Euros)

27.12.2016 a / to 27.03.2017

1.866,300000

186.630,00

Retención / Withholding tax

19,00%

354,597000

35.459,70

Neto / Net Interest

1.511,703000

151.170,30

* 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.