

**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 **18.11.2016**

Periodo de Interés / Interest accrual period desde / From **18.08.2016** (incluido) / (included)  
hasta / To **18.11.2016** (excluido) / (excluded)  
plazo / Term **92** días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3(G)	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series A3(G) Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0313273015	ES0313273023	ES0313273031	ES0313273049	ES0313273056	ES0313273064

**Determinación Interés Nominal**  
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	16.08.2016	-0,299%	-0,299%	-0,299%	-0,299%	-0,299%
Margen / Margin		0,200%	0,020%	0,350%	0,900%	1,800%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		<b>-0,099%</b>	<b>-0,279%</b>	<b>0,051%</b>	<b>0,601%</b>	<b>1,501%</b>
Tipo de interes aplicable / Applicable interest rate		<b>0,000%*</b>	<b>0,000%*</b>	<b>0,051%</b>	<b>0,601%</b>	<b>1,501%</b>

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	2.889		912		231		60		108		174
Número de Bonos / N. Bonds											
Nominal / Face value	(Euros)	14.947,17	43.182.374,13	36.950,70	33.699.038,40	100.000,00	23.100.000,00	100.000,00	6.000.000,00	100.000,00	10.800.000,00

**Liquidación de Intereses**  
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	13,033333	3.010,70	153,588889	9.215,33	383,588889	41.427,60	920,255556	160.124,47
Retención / Withholding tax		0,000000	0,00	0,000000	0,00	2,476333	572,03	29,181889	1.750,91	72,881889	7.871,24	174,848556	30.423,65
Intereses Neto / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	10,557000	2.438,67	124,407000	7.464,42	310,707000	33.556,36	745,407000	129.700,82

**Amortización de Principal**  
Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determine A determinar / To be determine **0,00** 0,00 **0,00** 0,00 **0,00** 0,00 **0,00** 0,00 **0,00** 0,00

**Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles**

Payments outstanding due to insufficient Available Funds (Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax **19,00%**

Intereses Neto / Net Interest

**18/08/2009 - 18/08/2016**

**32.553,838887** 5.664.367,96

**6.185,229387** 1.076.229,91

**26.368,609500** 4.588.138,05

\* 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.