

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

16.05.2017

Periodo de Interés /

desde / From

14.02.2017 (incluido) / (included)

Interest accrual period

hasta / To

16.05.2017 (excluido) / (excluded)

plazo / Term

91

días / days

Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds
ES0372259038	ES0372259046	ES0372259053

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

10.02.2017

-0,329%

-0,329%

-0,329%

Margen / Margin

0,280%

0,550%

4,000%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,049%

0,221%

3,671%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

0,000%*

0,221%

3,671%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

16.660,87

10.446.365,49

100.000,00

24.100.000,00

100.000,00

28.800.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross

Interest Retención / Withholding tax

19,00%

Neto / Net

0,000000

0,00

55,863889

13.463,20

927,947222

267.248,80

0,000000

0,00

10,614139

2.558,01

176,309972

50.777,27

0,000000

0,00

45,249750

10.905,19

751,637250

216.471,53

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments outstanding due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

19,00%

Neto / Net Interest

16.02.2009 / 14.02.2017

36.678,434514

10.563.389,14

6.968,902557

2.007.043,92

29.709,531957

8.556.345,22

* 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.