

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

16.08.2016

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

17.05.2016 (incluido) / (included)
16.08.2016 (excluido) / (excluded)
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 B Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0313716013	ES0313716021	ES0313716039	ES0313716047	ES0313716054

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	12/05/2016	-0,258%	-0,258%	-0,258%	-0,258%	-0,258%
Margen / Margin		0,120%	0,220%	0,520%	2,100%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,138%	-0,038%	0,262%	1,842%	3,642%
Tipo de interés aplicable / Interest rate		0,000%*	0,000%*	0,262%	1,842%	3,642%

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
	6.820		162		275		107		146
5.208,58	35.522.515,60	100.000,00	16.200.000,00	100.000,00	27.500.000,00	100.000,00	10.700.000,00	100.000,00	14.600.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross

Retención / Withholding tax

Neto / Net

19%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	66,227778	18.212,64	465,616667	49.820,98	920,616667	134.410,03
0,000000	0,00	0,000000	0,00	12,583278	3.460,40	88,467167	9.465,99	174,917167	25.537,91
0,000000	0,00	0,000000	0,00	53,644500	14.752,24	377,149500	40.354,99	745,699500	108.872,12

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
Payments outstanding due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Interés Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Neto / Net Interest

19%

16.11.2009-17.05.2016

30.304,236111 4.424.418,46

5.757,804861 840.639,51

24.546,431250 3.583.778,95

* 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.